

Fecha de publicación: 1 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 30 de Marzo de 2005 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$597,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,4	61,6	45,6	26,4	88,1
15-35	153,5	193,0	82,3	42,7	235,8
36-60	0,2	1,8	1,6	0,0	1,8
61-90	199,6	40,3	2,7	162,0	202,3
91-180	16,1	1,5	1,4	16,0	17,5
>180	51,0	25,8	0,8	26,0	51,8
Total	462,8	324,0	134,4	273,2	597,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,3 %	6,4 %
15-35	4,5 %	5,6 %
36-60	2,8 %	2,1 %
61-90	4,1 %	3,3 %
91-180	4,2 %	4,5 %
>180	4,3 %	4,3 %
Total	4,5 %	4,8 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	37	153	1171	1146	19	97	678	773	24	114	797	720
Real	151	35	567	592	94	17	453	359	114	24	384	461
Total	188	188	1738	1738	114	114	1132	1132	138	138	1181	1181

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 31 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.