

Fecha de publicación: 04 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 31 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\$396,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	132,7	180,5	69,5	21,7	202,2
15-35	65,7	61,3	22,3	26,7	88,0
36-60	0,7	0,4	0,4	0,7	1,2
61-90	2,1	0,4	0,2	2,0	2,4
91-180	75,0	32,2	7,2	50,0	82,2
>180	15,2	20,0	5,0	0,2	20,2
Total	291,4	294,9	104,8	101,2	396,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	6,5 %
15-35	3,8 %	3,8 %
36-60	4,1 %	4,3 %
61-90	5,1 %	5,1 %
91-180	4,9 %	3,8 %
>180	4,5 %	4,6 %
Total	6,1 %	5,2 %

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	20	101	723	809	25	118	892	864
Real	151	35	567	592	99	17	455	369	117	24	446	474
Total	188	188	1738	1738	118	118	1178	1178	141	141	1338	1338

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 1 de abril se presenta la proyección de vencimientos.