

Fecha de publicación: 07 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 05 de Abril 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\$217,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,1	35,1	5,1	38,1	73,1
15-35	96,6	55,5	14,5	55,6	111,1
36-60	20,6	20,6	10,3	10,3	30,9
61-90	-	0,3	0,3	-	0,3
91-180	-	1,3	1,3	-	1,3
>180	0,3	0,6	0,3	-	0,6
Total	185,6	113,3	31,8	104,0	217,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,1 %	7,6 %
15-35	4,0 %	3,8 %
36-60	4,2 %	3,9 %
61-90	4,7 %	4,6 %
91-180	4,8 %	4,7 %
>180	4,8 %	4,8 %
Total	4,8 %	5,1 %

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	4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril				18 al 22 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	20	101	796	860	28	118	1046	952	21	52	558	446
Real	99	17	462	399	117	27	453	548	51	20	149	261
Total	118	118	1258	1258	145	145	1500	1500	72	72	708	708

* 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 6 de abril se presenta la proyección de vencimientos.