

Fecha de publicación: 12 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 08 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\$360,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	161,9	136,9	18,9	43,9	180,8
15-35	96,8	74,2	31,2	53,8	128,1
36-60	0,5	0,5	0,5	0,5	1,0
61-90	-	27,3	27,3	-	27,3
91-180	0,0	5,0	5,0	0,0	5,1
>180	13,2	18,4	5,2	-	18,4
Total	272,5	262,4	88,2	98,3	360,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	30	118	1157	1065	22	52	907	779
Real	99	17	462	399	117	30	476	567	52	21	215	343
Total	118	118	1258	1258	147	147	1633	1633	73	73	1122	1122

* 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 11 de abril se presenta la proyección de vencimientos.