

Fecha de publicación: 14 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 12 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\$301,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	83,7	72,3	36,3	47,7	120,0
15-35	107,7	97,1	46,1	56,7	153,8
36-60	0,1	0,5	0,5	0,1	0,6
61-90	1,0	1,0	1,0	1,0	2,0
91-180	0,1	0,4	0,4	0,1	0,6
>180	22,0	4,2	2,2	20,0	24,2
Total	214,6	175,5	86,5	125,6	301,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	11 al 15 de Abril				18 al 22 de Abril				25 al 29 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	118	1176	1085	22	52	986	862	16	41	682	667
Real	117	30	476	568	52	22	247	371	41	16	325	340
Total	147	147	1652	1652	74	74	1233	1233	57	57	1007	1007

* 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 13 de abril se presenta la proyección de vencimientos.