

Fecha de Publicación: 15 de Abril de 2005

Fecha de Información: 13 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\$275,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	99,4	92,2	16,7	23,9	116,1
15-35	89,6	41,3	15,9	64,1	105,5
36-60	6,1	6,7	0,6	0,1	6,7
61-90	-	8,2	8,2	-	8,2
91-180	7,1	13,3	6,3	-	13,3
>180	10,0	25,8	15,8	-	25,8
Total	212,1	187,6	63,6	88,1	275,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	53	1061	926	16	41	735	707
Real	117	30	476	568	52	22	256	391	41	16	335	362
Total	147	147	1652	1652	74	74	1317	1317	57	57	1070	1070

* 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 14 de abril se presenta la proyección de vencimientos.