

Fecha de Publicación: 19 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 15 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\$290,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	114,8	87,2	20,2	47,8	135,0
15-35	94,6	92,1	29,9	32,4	124,5
36-60	4,9	1,0	0,0	3,9	4,9
61-90	6,4	8,7	8,7	6,4	15,1
91-180	6,2	3,7	3,7	6,2	9,9
>180	-	1,0	1,0	-	1,0
Total	227,0	193,8	63,5	96,8	290,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25	53	1183	1012	18	41	816	762
Real	117	30	476	568	52	25	272	442	41	18	347	400
Total	147	147	1652	1652	77	77	1454	1454	59	59	1162	1162

* 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 18 de abril se presenta la proyección de vencimientos.