

Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 18 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\$186,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,3	42,5	2,5	37,3	79,7
15-35	41,8	70,6	44,6	15,8	86,4
36-60	2,3	7,4	7,4	2,3	9,7
61-90	-	-	-	-	-
91-180	5,2	4,3	0,3	1,2	5,5
>180	5,0	5,0	-	-	5,0
Total	131,6	129,7	54,7	56,6	186,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	18 al 22 de Abril				25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	25	53	1201	1017	18	41	872	798	8	70	494	482
Real	52	25	273	456	41	18	347	421	69	8	226	237
Total	77	77	1473	1473	60	60	1219	1219	78	78	720	720

* 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 19 de abril se presenta la proyección de vencimientos.