

Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 19 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\$168,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,6	33,1	6,1	39,6	72,6
15-35	70,7	51,6	20,0	39,1	90,7
36-60	1,1	1,8	1,1	0,5	2,2
61-90	1,0	0,2	0,2	1,0	1,2
91-180	0,3	1,4	1,2	-	1,4
>180	-	0,2	0,2	-	0,2
Total	139,6	88,4	28,9	80,1	168,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,1 %	12,4 %
15-35	3,5 %	3,2 %
36-60	2,5 %	3,5 %
61-90	2,7 %	3,1 %
91-180	4,1 %	4,3 %
>180	4,2 %	4,2 %
Total	4,3 %	7,2 %

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	1230	1025	19	43	906	822	9	70	500	488
Real	52	25	273	479	42	19	351	435	69	8	226	239
Total	77	77	1504	1504	61	61	1257	1257	78	78	727	727

* 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 20 de abril se presenta la proyección de vencimientos.