

Fecha de Publicación: 22 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 20 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\$203,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,6	66,9	17,9	4,6	71,6
15-35	65,1	67,5	25,1	22,7	90,2
36-60	17,2	21,2	5,2	1,2	22,3
61-90	3,0	8,5	5,5	-	8,5
91-180	0,7	1,0	0,9	0,6	1,6
>180	6,0	8,9	2,9	-	8,9
Total	145,6	173,9	57,4	29,1	203,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,4 %	3,5 %
15-35	3,6 %	4,2 %
36-60	3,8 %	4,1 %
61-90	4,0 %	3,3 %
91-180	3,7 %	3,6 %
>180	4,3 %	4,1 %
Total	3,4 %	3,9 %

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	20	43	946	878	9	70	523	512
Real	52	25	273	479	43	20	368	436	70	9	231	241
Total	77	77	1504	1504	63	63	1314	1314	79	79	754	754

* 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 21 de abril se presenta la proyección de vencimientos.