

Fecha de Publicación: 25 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 21 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\$158,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28,1	26,8	10,6	12,0	38,8
15-35	70,8	52,5	19,7	38,0	90,5
36-60	0,4	5,4	5,0	-	5,4
61-90	-	7,6	7,6	-	7,6
91-180	0,1	10,0	10,0	0,1	10,1
>180	-	6,2	6,2	-	6,2
Total	99,5	108,5	59,1	50,1	158,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22	42	965	903	10	70	532	516
Real	52	25	273	479	42	22	377	439	70	9	234	250
Total	77	77	1504	1504	64	64	1342	1342	79	79	766	766

* 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 22 de abril se presenta la proyección de vencimientos.