

Fecha de Publicación: 26 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 22 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\$240,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,9	70,4	37,8	22,3	92,7
15-35	84,4	83,8	23,2	23,8	107,6
36-60	7,0	14,7	11,7	3,9	18,6
61-90	7,0	6,2	6,2	7,0	13,2
91-180	0,3	2,2	2,2	0,3	2,4
>180	5,0	6,1	1,1	-	6,1
Total	158,5	183,5	82,2	57,2	240,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	24	42	993	932	11	70	557	557
Real	52	25	273	479	42	23	393	454	70	10	256	256
Total	77	77	1504	1504	66	66	1385	1385	81	81	813	813

* 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 25 de abril se presenta la proyección de vencimientos.