

Fecha de Publicación: 27 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 25 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\$224,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9,4	31,0	26,0	4,4	35,4
15-35	78,0	68,8	5,7	14,9	83,8
36-60	36,0	44,2	42,2	33,9	78,2
61-90	12,0	-	-	12,0	12,0
91-180	0,3	9,4	9,1	-	9,4
>180	-	6,0	6,0	-	6,0
Total	135,7	159,5	89,1	65,3	224,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-4,0 %	-16,9 %
15-35	4,5 %	4,9 %
36-60	3,3 %	2,6 %
61-90	3,9 %	3,9 %
91-180	3,6 %	2,6 %
>180	4,4 %	4,3 %
Total	2,3 %	0,5 %

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	25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	24	42	998	956	11	71	561	563	14	57	647	571
Real	42	23	414	455	70	11	261	259	57	13	144	219
Total	66	66	1411	1411	82	82	822	822	70	70	790	790

* 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 26 de abril se presenta la proyección de vencimientos.