

Fecha de Publicación: 28 de Abril de 2005
 Fecha de Información: 26 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\$293,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,5	42,0	23,0	16,5	58,5
15-35	123,1	136,1	57,6	44,6	180,8
36-60	25,7	21,3	13,3	17,7	39,0
61-90	2,5	13,5	11,0	-	13,5
91-180	0,1	1,4	1,4	0,1	1,4
>180	0,2	0,6	0,6	0,2	0,8
Total	187,1	214,9	106,9	79,1	293,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,4 %	3,0 %
15-35	3,3 %	3,4 %
36-60	3,6 %	3,4 %
61-90	3,6 %	4,0 %
91-180	4,0 %	4,5 %
>180	11,2 %	8,3 %
Total	3,4 %	3,4 %

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	26	42	1012	965	12	71	578	594	14	57	687	610
Real	42	26	415	461	70	12	281	265	57	13	151	227
Total	68	68	1427	1427	82	82	860	860	71	71	838	838

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 27 de abril se presenta la proyección de vencimientos.