

Fecha de Publicación: 5 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 03 de Mayo 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\$150,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,1	35,2	10,7	8,6	43,8
15-35	49,2	39,8	3,8	13,2	52,9
36-60	20,0	30,2	10,1	-	30,2
61-90	4,0	2,4	2,4	4,0	6,4
91-180	-	0,1	0,1	-	0,1
>180	16,3	0,4	0,4	16,3	16,7
Total	122,7	107,9	27,4	42,1	150,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo				16 al 20 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	71	783	719	17	57	773	683	10	28	637	554
Real	71	15	310	374	57	16	160	250	27	9	223	305
Total	86	86	1093	1093	74	74	934	934	37	37	860	860

* 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 4 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.