

Fecha de Publicación: 20 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 18 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\$222,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,2	33,5	5,5	35,2	68,8
15-35	80,1	74,3	33,4	39,1	113,4
36-60	15,5	10,8	10,8	15,5	26,3
61-90	-	1,2	1,2	-	1,2
91-180	-	6,2	6,2	-	6,2
>180	2,0	6,7	4,7	-	6,7
Total	160,8	132,7	61,8	89,9	222,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,4 %	5,8 %
15-35	3,5 %	3,7 %
36-60	4,2 %	3,8 %
61-90	4,2 %	3,8 %
91-180	4,3 %	4,1 %
>180	4,4 %	4,1 %
Total	4,0 %	4,4 %

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	16 al 20 de Mayo				23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	28	789	746	15	29	836	792	8	31	509	430
Real	28	12	329	372	28	14	324	368	31	8	163	243
Total	40	40	1118	1118	43	43	1161	1161	39	39	673	673

* 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 19 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.