

Fecha de Publicación: 1 de Junio de 2005
Fecha de Información: 27 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\$386,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	102,3	107,9	45,4	39,8	147,7
15-35	153,9	114,3	14,8	54,4	168,7
36-60	6,7	0,2	0,2	6,7	6,9
61-90	-	0,7	0,7	-	0,7
91-180	-	59,2	59,2	-	59,2
>180	2,3	2,8	0,7	0,1	2,9
Total	265,2	285,2	121,0	101,0	386,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,6 %	4,4 %
15-35	2,9 %	3,3 %
36-60	3,9 %	3,7 %
61-90	4,1 %	4,1 %
91-180	4,0 %	3,7 %
>180	4,2 %	3,9 %
Total	4,0 %	3,8 %

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	23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio				6 al 10 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	21	29	921	863	12	32	753	597	9	33	640	641
Real	29	20	345	402	31	11	199	355	33	8	276	275
Total	50	50	1266	1266	43	43	952	952	41	41	916	916

* 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 30 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.