

Fecha de Publicación: 2 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 28 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\$303,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 100,0 | 35,5 | 2,0 | 66,5 | 102,0 |
| 15-35 | 102,4 | 63,3 | 20,3 | 59,4 | 122,6 |
| 36-60 | 28,9 | 30,3 | 1,8 | 0,4 | 30,7 |
| 61-90 | 0,2 | 1,9 | 1,9 | 0,2 | 2,1 |
| 91-180 | 3,5 | 5,1 | 2,1 | 0,5 | 5,6 |
| >180 | - | 40,1 | 40,1 | - | 40,1 |
| Total | 235,0 | 176,2 | 68,2 | 127,0 | 303,2 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 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 | 13 | 71 | 729 | 656 | 15 | 57 | 726 | 643 |
| Real | 42 | 26 | 415 | 461 | 71 | 12 | 287 | 360 | 57 | 14 | 153 | 236 |
| Total | 68 | 68 | 1427 | 1427 | 83 | 83 | 1016 | 1016 | 71 | 71 | 879 | 879 |

* 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 29 de abril se presenta la proyección de vencimientos.