

Fecha de Publicación: 06 de Mayo de 2005  
 Fecha de Información: 04 de Mayo de 2005 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$165,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,5	25,7	4,7	21,5	47,2
15-35	75,2	28,1	10,1	57,2	85,3
36-60	16,5	5,6	0,6	11,5	17,1
61-90	0,5	0,8	0,8	0,5	1,2
91-180	0,9	6,3	6,0	0,6	6,9
>180	1,0	7,9	6,9	-	7,9
<b>Total</b>	<b>136,6</b>	<b>74,4</b>	<b>29,1</b>	<b>91,3</b>	<b>165,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,9 %	11,2 %
15-35	3,5 %	3,7 %
36-60	3,8 %	3,9 %
61-90	4,0 %	3,8 %
91-180	4,1 %	4,1 %
>180	4,5 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>5,9 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**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
<b>Financiero</b>	15	71	783	719	17	58	809	704	10	28	647	559
<b>Real</b>	71	15	310	374	57	16	163	268	27	10	224	311
<b>Total</b>	86	86	1093	1093	74	74	972	972	37	37	871	871

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 5 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.