

Fecha de Publicación: 10 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 05 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\$288,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 78,3 | 79,7 | 11,2 | 9,8 | 89,4 |
| 15-35 | 127,4 | 70,4 | 47,4 | 104,4 | 174,8 |
| 36-60 | 8,2 | 10,9 | 4,9 | 2,2 | 13,1 |
| 61-90 | 2,0 | 9,4 | 7,4 | - | 9,4 |
| 91-180 | 0,4 | 1,7 | 1,3 | 0,1 | 1,8 |
| >180 | - | - | - | - | - |
| Total | 216,3 | 172,0 | 72,1 | 116,4 | 288,4 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 58 | 875 | 770 | 10 | 28 | 663 | 575 |
| Real | 71 | 15 | 310 | 374 | 57 | 16 | 169 | 274 | 27 | 10 | 230 | 317 |
| Total | 86 | 86 | 1093 | 1093 | 74 | 74 | 1044 | 1044 | 38 | 38 | 892 | 892 |

* 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 6 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.