

Fecha de Publicación: 11 de Mayo de 2005  
 Fecha de Información: 06 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\$236,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	55,7	74,4	24,6	5,9	80,3
15-35	87,1	84,3	30,3	33,1	117,4
36-60	22,1	23,2	1,2	0,0	23,3
61-90	-	0,0	0,0	-	0,0
91-180	1,7	3,6	3,6	1,7	5,3
>180	10,2	10,0	-	0,2	10,2
<b>Total</b>	<b>176,8</b>	<b>195,5</b>	<b>59,7</b>	<b>41,0</b>	<b>236,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,0 %	-1,6 %
15-35	2,4 %	2,7 %
36-60	3,6 %	3,7 %
61-90	4,0 %	4,0 %
91-180	3,8 %	3,5 %
>180	3,6 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>1,4 %</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	19	58	902	819	11	28	690	601
<b>Real</b>	71	15	310	374	57	18	192	275	27	10	231	320
<b>Total</b>	86	86	1093	1093	76	76	1094	1094	38	38	921	921

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 9 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.