

Fecha de Publicación: 12 de Mayo de 2005  
 Fecha de Información: 10 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\$248,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	29,9	30,3	5,3	4,9	35,2
15-35	99,2	98,3	25,0	26,0	124,3
36-60	34,8	14,8	3,7	23,8	38,5
61-90	-	40,4	40,4	-	40,4
91-180	5,0	0,9	0,8	5,0	5,9
>180	4,0	4,5	0,5	-	4,5
<b>Total</b>	<b>173,0</b>	<b>189,1</b>	<b>75,7</b>	<b>59,7</b>	<b>248,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,0 %	6,1 %
15-35	3,7 %	4,1 %
36-60	4,2 %	3,8 %
61-90	4,0 %	3,7 %
91-180	4,3 %	3,0 %
>180	3,8 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,2 %</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	9 al 13 de Mayo				16 al 20 de Mayo				23 al 27 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	20	58	915	836	11	28	702	614	11	28	562	560
<b>Real</b>	57	19	196	275	27	10	233	320	28	11	277	279
<b>Total</b>	77	77	1111	1111	38	38	934	934	39	39	839	839

\* 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 11 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.