

Fecha de Publicación: 16 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 12 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\$303,0 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	75,0	47,8	9,8	37,0	84,8
15-35	132,1	96,5	50,0	85,6	182,1
36-60	15,6	26,4	12,4	1,6	28,0
61-90	-	3,5	3,5	-	3,5
91-180	2,2	3,3	1,3	0,2	3,5
>180	0,3	0,8	0,8	0,3	1,1
Total	225,1	178,4	77,9	124,6	303,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	2,9 %
15-35	3,4 %	3,8 %
36-60	3,5 %	2,8 %
61-90	3,8 %	3,6 %
91-180	4,3 %	4,3 %
>180	4,3 %	4,0 %
Total	3,2 %	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	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
Financiero	20	58	915	836	12	28	754	657	12	28	650	637
Real	57	19	196	275	27	12	247	344	28	11	290	303
Total	77	77	1111	1111	39	39	1001	1001	40	40	940	940

* 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 13 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.