

Fecha de Publicación: 18 de Mayo de 2005  
 Fecha de Información: 16 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\$292,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	51,6	57,9	32,9	26,6	84,4
15-35	131,8	94,6	18,6	55,8	150,4
36-60	29,1	17,0	2,0	14,1	31,1
61-90	5,0	0,8	0,8	5,0	5,8
91-180	1,0	3,6	3,5	1,0	4,6
>180	5,1	16,0	10,9	-	16,0
<b>Total</b>	<b>223,5</b>	<b>189,8</b>	<b>68,7</b>	<b>102,4</b>	<b>292,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,8 %	8,8 %
15-35	4,0 %	4,0 %
36-60	3,9 %	3,9 %
61-90	4,4 %	4,3 %
91-180	4,5 %	4,2 %
>180	4,4 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,4 %</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	16 al 20 de Mayo				23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	28	781	746	13	28	716	687	8	31	478	403
Real	27	12	329	363	28	12	305	334	31	7	158	233
<b>Total</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>1109</b>	<b>1109</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>1021</b>	<b>1021</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>635</b>	<b>635</b>

\* 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 17 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.