

Fecha de Publicación: 23 de Mayo de 2005  
 Fecha de Información: 19 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\$185,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,9	32,5	3,5	11,9	44,4
15-35	64,7	50,1	3,1	17,7	67,8
36-60	27,2	32,7	6,2	0,7	33,4
61-90	23,0	6,4	0,3	17,0	23,4
91-180	2,0	11,6	9,6	-	11,6
>180	5,0	0,2	0,2	5,0	5,2
<b>Total</b>	<b>162,8</b>	<b>133,4</b>	<b>22,9</b>	<b>52,2</b>	<b>185,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	3,4 %
15-35	3,7 %	4,1 %
36-60	3,7 %	3,7 %
61-90	4,3 %	4,0 %
91-180	4,0 %	4,0 %
>180	4,2 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,8 %</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
<b>Financiero</b>	12	28	789	746	20	29	839	796	8	31	553	469
<b>Real</b>	28	12	329	372	28	19	328	371	31	8	163	247
<b>Total</b>	40	40	1118	1118	47	47	1167	1167	39	39	716	716

\* 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 20 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.