

Fecha de Publicación: 24 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 20 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\$191,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,7	34,7	11,7	17,7	52,4
15-35	60,5	69,9	25,3	15,9	85,8
36-60	20,4	15,2	0,2	5,4	20,7
61-90	10,0	4,2	4,2	10,0	14,2
91-180	-	18,0	18,0	-	18,0
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	131,7	142,1	59,5	49,1	191,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,8 %	2,8 %
15-35	3,7 %	3,6 %
36-60	3,7 %	3,4 %
61-90	5,1 %	4,1 %
91-180	4,2 %	3,8 %
>180	4,4 %	4,6 %
Total	5,2 %	3,4 %

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	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	789	746	20	29	856	815	9	31	576	484
Real	28	12	329	372	28	19	335	376	31	9	168	259
Total	40	40	1118	1118	48	48	1191	1191	39	39	744	744

* 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 23 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.