

Fecha de Publicación: 25 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 23 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\$254,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	79,6	76,8	37,1	40,0	116,7
15-35	55,4	48,3	21,8	28,8	77,1
36-60	7,7	6,7	6,7	7,7	14,4
61-90	5,5	3,4	3,3	5,5	8,9
91-180	0,0	34,4	34,4	-	34,4
>180	-	2,6	2,6	-	2,6
Total	148,2	172,2	105,9	81,9	254,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,2 %	7,2 %
15-35	3,9 %	4,1 %
36-60	4,6 %	4,3 %
61-90	4,6 %	4,3 %
91-180	4,3 %	3,9 %
>180	4,5 %	4,5 %
Total	4,8 %	5,5 %

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	23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio				6 al 10 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	20	29	893	847	9	31	617	529	6	33	511	522
Real	28	19	345	391	31	9	195	283	33	6	221	210
Total	49	49	1238	1238	40	40	812	812	38	38	733	733

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 24 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.