

Fecha de Publicación: 27 de Mayo de 2005
Fecha de Información: 25 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\$152,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,4	24,1	4,1	10,4	34,5
15-35	75,6	48,0	9,3	36,9	84,9
36-60	17,1	10,2	5,2	12,1	22,3
61-90	-	1,4	1,4	-	1,4
91-180	0,8	3,1	3,1	0,8	3,9
>180	4,3	5,3	1,0	-	5,3
Total	128,3	92,2	24,1	60,2	152,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	21	29	921	863	11	31	651	542	7	33	588	573
Real	29	20	345	402	31	10	199	308	33	7	228	243
Total	50	50	1266	1266	42	42	850	850	40	40	816	816

* 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 26 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.