

Fecha de Publicación: 3 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 29 de Abril 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\$285,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	50,8	54,3	16,3	12,8	67,1
15-35	124,5	139,4	69,8	54,9	194,3
36-60	1,2	6,3	6,3	1,2	7,5
61-90	2,0	0,3	0,3	2,0	2,3
91-180	12,1	4,1	2,1	10,1	14,2
>180	-	-	-	-	-
Total	190,5	204,4	94,8	81,0	285,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,7 %	-1,4 %
15-35	2,7 %	3,8 %
36-60	3,4 %	2,9 %
61-90	3,8 %	3,2 %
91-180	4,0 %	4,3 %
>180	-	-
Total	2,3 %	2,6 %

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	25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	42	1012	965	13	71	765	701	16	57	739	652
Real	42	26	415	461	71	13	298	362	57	16	158	245
Total	68	68	1427	1427	84	84	1063	1063	73	73	897	897

* 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 2 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.