

Fecha de Publicación: 26 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 24 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\$159,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	60,9	30,4	1,4	31,9	62,3
15-35	50,8	37,9	16,3	29,2	67,1
36-60	1,1	1,6	1,6	1,1	2,7
61-90	-	10,7	10,7	-	10,7
91-180	0,1	16,9	16,9	-	16,9
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
Total	112,9	97,6	47,0	62,2	159,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	10	31	636	529	7	33	551	555
Real	29	20	345	402	31	10	195	302	33	6	228	224
Total	50	50	1266	1266	41	41	831	831	39	39	779	779

* 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 25 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.