

Fecha de Publicación: 4 de Mayo de 2005
 Fecha de Información: 02 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\$163,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,8	45,8	5,8	13,8	59,6
15-35	71,3	48,5	12,5	35,3	83,8
36-60	6,7	5,7	0,4	1,4	7,1
61-90	0,0	0,2	0,2	-	0,2
91-180	5,0	2,9	2,8	5,0	7,9
>180	2,0	4,9	2,9	-	4,9
Total	138,9	107,9	24,6	55,5	163,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,9 %	0,9 %
15-35	3,3 %	3,7 %
36-60	3,6 %	3,9 %
61-90	4,9 %	5,1 %
91-180	4,5 %	4,3 %
>180	4,8 %	4,9 %
Total	3,1 %	2,8 %

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	2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo				16 al 20 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	71	775	712	16	57	773	682	9	28	605	522
Real	71	15	303	366	57	16	159	250	27	9	220	303
Total	86	86	1078	1078	73	73	932	932	37	37	826	826

* 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 3 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.