

Fecha de Publicación: 2 de Junio de 2005
Fecha de Información: 31 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\$273,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,4	43,6	20,1	6,9	50,5
15-35	114,1	128,0	64,5	50,6	178,6
36-60	24,9	7,2	0,2	17,9	25,1
61-90	1,0	0,0	0,0	1,0	1,0
91-180	-	18,0	18,0	-	18,0
>180	-	0,5	0,5	-	0,5
Total	170,4	197,2	103,2	76,4	273,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	30 de May. al 3 de Junio				6 al 10 de Junio				13 al 17 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	32	761	604	9	33	658	657	17	37	585	565
Real	31	11	200	356	33	8	276	277	37	17	284	304
Total	43	43	960	960	41	41	934	934	54	54	869	869

* 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 1 de junio se presenta la proyección de vencimientos.