

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2005  
 Fecha de Información: 29 de Julio de 2005 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$200,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,9	49,8	31,8	48,9	98,7
15-35	50,0	35,1	33,1	48,0	83,1
36-60	0,3	1,4	1,4	0,3	1,7
61-90	-	6,3	6,3	-	6,3
91-180	1,7	4,3	4,3	1,7	6,0
>180	-	4,1	4,1	-	4,1
<b>Total</b>	<b>119,0</b>	<b>101,0</b>	<b>81,0</b>	<b>99,0</b>	<b>200,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	9	28	866	916	5	61	542	342	4	96	553	404
<b>Real</b>	28	9	521	472	61	5	127	328	95	4	203	352
<b>Total</b>	37	37	1387	1387	66	66	669	669	100	100	756	756

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 1 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.