

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2005  
 Fecha de Información: 09 de Agosto 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\$280,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,5	8,3	8,3	13,5	21,7
15-35	99,7	54,0	30,0	75,7	129,7
36-60	63,5	1,8	1,3	63,0	64,8
61-90	0,5	1,2	1,2	0,5	1,6
91-180	51,3	8,0	8,0	51,3	59,3
>180	2,0	1,3	1,3	2,0	3,3
<b>Total</b>	<b>230,4</b>	<b>74,6</b>	<b>50,1</b>	<b>205,9</b>	<b>280,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,8 %	6,0 %
15-35	1,6 %	1,3 %
36-60	1,8 %	1,5 %
61-90	2,1 %	2,0 %
91-180	2,5 %	1,9 %
>180	3,1 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>1,8 %</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	8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	7	118	686	564	18	75	488	483	10	56	359	355
<b>Real</b>	118	7	269	391	75	18	288	293	55	9	196	200
<b>Total</b>	125	125	955	955	93	93	776	776	65	65	555	555

\* 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 10 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.