

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2005  
 Fecha de Información: 30 de Junio 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\$239,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,3	53,0	27,5	4,8	57,8
15-35	72,2	100,7	61,2	32,7	133,4
36-60	20,0	9,1	9,1	20,0	29,1
61-90	9,2	6,1	0,1	3,2	9,2
91-180	1,0	0,1	0,1	1,0	1,1
>180	6,0	8,9	2,9	-	8,9
<b>Total</b>	<b>138,7</b>	<b>177,8</b>	<b>100,8</b>	<b>61,7</b>	<b>239,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,1 %	5,3 %
15-35	2,4 %	3,1 %
36-60	4,0 %	3,6 %
61-90	4,1 %	4,1 %
91-180	4,0 %	4,0 %
>180	4,3 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,8 %</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	27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio				11 al 15 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	16	37	911	889	11	49	783	757	15	35	847	688
<b>Real</b>	37	15	366	389	49	11	376	403	33	14	303	462
<b>Total</b>	53	53	1278	1278	61	61	1159	1159	48	48	1150	1150

\* 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 julio se presenta la proyección de vencimientos.