

Fecha de Publicación: 07 de Julio de 2005  
 Fecha de Información: 05 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\$273,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,8	100,7	71,7	35,8	136,5
15-35	53,3	43,6	22,6	32,3	75,9
36-60	40,8	-	-	40,8	40,8
61-90	5,4	0,7	0,7	5,4	6,2
91-180	6,6	4,2	4,2	6,6	10,9
>180	2,2	0,8	0,8	2,2	3,0
<b>Total</b>	<b>173,2</b>	<b>150,0</b>	<b>100,0</b>	<b>123,2</b>	<b>273,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,6 %	3,4 %
15-35	3,0 %	3,2 %
36-60	3,5 %	3,3 %
61-90	3,4 %	3,5 %
91-180	3,7 %	3,6 %
>180	3,7 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,3 %</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	18 al 22 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>	6	28	505	374	13	47	794	761	18	35	923	815
<b>Real</b>	28	6	157	288	47	13	380	413	34	17	386	493
<b>Total</b>	34	34	662	662	61	61	1174	1174	51	51	1309	1309

\* 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 6 de julio se presenta la proyección de vencimientos.