

Fecha de Publicación: 1 de Septiembre de 2005

Fecha de Información: 30 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\$219,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20,1	1,1	1,1	20,1	21,2
15-35	39,2	83,6	67,6	23,2	106,8
36-60	5,0	37,0	35,0	3,0	40,0
61-90	6,2	18,2	17,2	5,2	23,4
91-180	0,4	26,3	26,3	0,4	26,6
>180	0,0	1,7	1,7	0,0	1,7
<b>Total</b>	<b>70,9</b>	<b>167,8</b>	<b>148,8</b>	<b>51,9</b>	<b>219,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	-0,2 %
15-35	0,4 %	0,7 %
36-60	1,2 %	1,4 %
61-90	1,7 %	1,7 %
91-180	2,8 %	2,1 %
>180	2,3 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,0 %</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	29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	6	63	487	290	5	177	436	331	13	144	614	389
<b>Real</b>	63	6	119	316	176	5	181	286	143	13	253	478
<b>Total</b>	69	69	606	606	182	182	617	617	157	157	867	867

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 31 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.