

**Fecha de Publicación: 09 de Septiembre de 2005**  
**Fecha de Información: 07 de Septiembre 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\$166,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	69,0	62,6	6,6	13,0	75,7
15-35	34,5	24,3	16,1	26,3	50,6
36-60	0,2	2,1	2,1	0,2	2,3
61-90	13,5	6,8	0,8	7,5	14,3
91-180	20,2	3,3	3,3	20,2	23,5
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
<b>Total</b>	<b>137,5</b>	<b>99,1</b>	<b>28,9</b>	<b>67,3</b>	<b>166,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,1 %	0,1 %
15-35	0,1 %	0,1 %
36-60	0,8 %	0,7 %
61-90	1,0 %	0,8 %
91-180	1,8 %	1,1 %
>180	2,9 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,3 %</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	5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	9	181	519	377	21	167	779	508	3	76	344	381
<b>Real</b>	181	8	216	358	167	21	285	556	76	3	273	237
<b>Total</b>	189	189	735	735	188	188	1064	1064	78	78	617	617

\* 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 8 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.