

**Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2005**  
**Fecha de Información: 12 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\$234,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89,1	63,4	8,4	34,1	97,5
15-35	46,1	51,3	26,3	21,1	72,4
36-60	10,1	12,5	7,5	5,1	17,6
61-90	4,0	4,6	4,6	4,0	8,6
91-180	18,6	6,5	1,5	13,6	20,1
>180	18,2	4,2	0,0	14,0	18,2
<b>Total</b>	<b>186,0</b>	<b>142,5</b>	<b>48,3</b>	<b>91,8</b>	<b>234,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,4 %	0,8 %
15-35	-0,3 %	0,1 %
36-60	0,1 %	0,6 %
61-90	0,6 %	0,8 %
91-180	0,8 %	0,7 %
>180	1,7 %	1,9 %
<b>Total</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,7 %</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	12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	25	176	934	610	5	79	465	426	3	67	401	353
<b>Real</b>	175	24	291	616	79	5	276	315	67	3	277	324
<b>Total</b>	200	200	1226	1226	84	84	741	741	69	69	678	678

\* 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 13 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.