

**Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2005**  
**Fecha de Información: 22 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\$181,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,8	69,0	6,0	3,8	72,8
15-35	10,3	93,4	88,4	5,3	98,7
36-60	0,2	-	-	0,2	0,2
61-90	3,8	4,4	4,4	3,8	8,2
91-180	0,3	0,9	0,9	0,3	1,1
>180	-	0,1	0,1	-	0,1
<b>Total</b>	<b>81,4</b>	<b>167,7</b>	<b>99,7</b>	<b>13,4</b>	<b>181,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-3,7 %	-4,6 %
15-35	-0,9 %	-0,6 %
36-60	-1,7 %	-1,7 %
61-90	0,3 %	0,3 %
91-180	1,0 %	1,1 %
>180	2,1 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>-1,3 %</b>	<b>-2,2 %</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	19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	45	92	559	525	5	74	628	558	7	79	611	316
<b>Real</b>	91	45	303	337	73	5	310	381	79	7	93	387
<b>Total</b>	136	136	862	862	79	79	938	938	86	86	703	703

\* 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 23 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.