

**Fecha de Publicación: 03 de Octubre de 2005**  
**Fecha de Información: 29 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\$190,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,5	31,7	2,7	19,5	51,2
15-35	21,6	50,7	49,7	20,6	71,3
36-60	5,1	16,3	16,3	5,1	21,4
61-90	16,1	20,6	15,6	11,1	31,7
91-180	12,2	2,7	2,7	12,2	14,9
>180	0,1	0,1	0,1	-	0,1
<b>Total</b>	<b>103,5</b>	<b>122,1</b>	<b>87,1</b>	<b>68,4</b>	<b>190,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,4 %	0,8 %
15-35	-0,3 %	-0,1 %
36-60	0,7 %	1,0 %
61-90	0,9 %	0,7 %
91-180	1,1 %	1,0 %
>180	1,9 %	1,4 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,5 %</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	26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	6	77	677	586	14	81	728	432	12	137	407	263
<b>Real</b>	77	5	310	401	81	14	102	398	136	11	109	253
<b>Total</b>	82	82	987	987	95	95	830	830	148	148	516	516

\* 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 30 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.