

**Fecha de Publicación: 7 de Octubre de 2005**  
**Fecha de Información: 05 de Octubre 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\$197,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de  $-0,4\%$ .<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,1	13,9	1,9	35,1	49,1
15-35	77,3	48,8	32,8	61,3	110,0
36-60	7,9	0,6	0,6	7,9	8,6
61-90	3,4	5,3	5,3	3,4	8,7
91-180	3,6	8,4	8,4	3,6	12,0
>180	8,2	0,3	0,3	8,2	8,5
<b>Total</b>	<b>147,5</b>	<b>77,5</b>	<b>49,5</b>	<b>119,5</b>	<b>197,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,1 %	-2,0 %
15-35	-0,3 %	-0,1 %
36-60	0,1 %	0,1 %
61-90	0,3 %	0,8 %
91-180	0,6 %	1,0 %
>180	1,2 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>-0,3 %</b>	<b>-0,4 %</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	3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	15	98	760	454	49	158	504	330	5	72	646	414
<b>Real</b>	98	15	116	421	156	47	113	286	72	4	269	501
<b>Total</b>	113	113	875	875	205	205	617	617	77	77	915	915

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 6 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.