

**Fecha de Publicación: 24 de Octubre de 2005**  
**Fecha de Información: 20 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\$284,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	81,6	48,2	4,2	37,6	85,8
15-35	133,6	24,2	9,2	118,6	142,8
36-60	8,2	1,1	0,1	7,2	8,4
61-90	11,9	1,6	1,6	11,9	13,4
91-180	17,8	1,1	1,1	17,8	18,9
>180	15,3	0,0	0,0	15,3	15,3
<b>Total</b>	<b>268,4</b>	<b>76,3</b>	<b>16,3</b>	<b>208,4</b>	<b>284,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,0 %	2,8 %
15-35	2,1 %	1,3 %
36-60	1,9 %	1,8 %
61-90	1,2 %	2,1 %
91-180	0,8 %	1,7 %
>180	1,4 %	2,2 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>1,9 %</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	17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	11	72	779	527	17	103	589	505	8	142	398	210
<b>Real</b>	72	10	316	569	103	16	273	357	141	7	95	282
<b>Total</b>	83	83	1096	1096	119	119	862	862	149	149	492	492

\* 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 21 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.