

**Fecha de Publicación: 25 de Octubre de 2005**  
**Fecha de Información: 21 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\$70,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,9	20,1	5,1	9,9	30,1
15-35	26,0	17,9	8,9	17,0	34,9
36-60	1,4	0,3	0,3	1,4	1,8
61-90	1,7	0,1	0,1	1,7	1,8
91-180	1,2	0,8	0,6	1,0	1,8
>180	-	0,3	0,3	-	0,3
<b>Total</b>	<b>55,2</b>	<b>39,6</b>	<b>15,4</b>	<b>31,0</b>	<b>70,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,4 %	1,4 %
15-35	1,5 %	2,1 %
36-60	1,6 %	1,5 %
61-90	1,3 %	1,4 %
91-180	2,1 %	2,0 %
>180	2,7 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>2,8 %</b>	<b>1,8 %</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	18	103	611	523	10	142	398	212
<b>Real</b>	72	10	316	569	103	17	276	364	142	9	96	282
<b>Total</b>	83	83	1096	1096	121	121	888	888	151	151	494	494

\* 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 24 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.