

**Fecha de Publicación: 5 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 3 de Octubre de 2006**<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\$311,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,2	19,4	8,3	8,1	27,4
15-35	131,5	106,8	102,8	127,5	234,3
36-60	2,4	0,0	0,0	2,4	2,4
61-90	1,6	0,0	0,0	1,6	1,6
91-180	0,0	3,2	3,2	0,0	3,2
>180	22,2	20,0	20,0	22,2	42,2
<b>Total</b>	<b>176,9</b>	<b>149,4</b>	<b>134,3</b>	<b>161,8</b>	<b>311,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	4,7 %
15-35	2,9 %	1,9 %
36-60	3,4 %	4,4 %
61-90	2,9 %	2,6 %
91-180	3,5 %	3,2 %
>180	3,1 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,3 %</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	2 al 6 de Octubre				9 al 13 de Octubre				16 al 20 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	191	21	574	529	36	22	527	484	11	14	522	360
<b>Real</b>	21	191	367	413	22	36	359	402	14	11	272	433
<b>Total</b>	212	212	942	942	57	57	886	886	25	25	794	794

\* 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 4 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.