

**Fecha de Publicación: 9 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 5 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\$270,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,8	26,8	3,8	22,8	49,6
15-35	121,0	70,0	63,0	114,0	184,0
36-60	5,1	5,5	5,5	5,1	10,6
61-90	0,6	12,9	12,9	0,6	13,5
91-180	1,5	11,0	11,0	1,5	12,5
>180	0,6	0,1	0,1	0,6	0,7
<b>Total</b>	<b>174,6</b>	<b>126,3</b>	<b>96,3</b>	<b>144,6</b>	<b>270,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,8 %	7,3 %
15-35	3,7 %	3,1 %
36-60	3,5 %	3,7 %
61-90	3,4 %	3,5 %
91-180	3,3 %	3,4 %
>180	3,1 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>4,0 %</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**

Sector	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>	198	20	568	529	38	22	586	532	11	15	572	393
<b>Real</b>	20	198	368	407	22	38	366	420	15	11	286	466
<b>Total</b>	218	218	936	936	59	59	952	952	26	26	858	858

\* 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.