

**Fecha de Publicación: 10 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 6 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\$214,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,5	54,0	22,0	7,5	61,5
15-35	44,4	55,2	55,2	44,4	99,6
36-60	0,7	3,3	3,3	0,7	4,0
61-90	1,0	0,8	0,8	1,0	1,8
91-180	4,0	4,5	4,5	4,0	8,5
>180	35,0	4,3	4,3	35,0	39,3
<b>Total</b>	<b>124,6</b>	<b>122,1</b>	<b>90,1</b>	<b>92,6</b>	<b>214,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,3 %	4,2 %
15-35	3,4 %	3,1 %
36-60	3,2 %	4,6 %
61-90	3,6 %	3,0 %
91-180	3,5 %	3,4 %
>180	3,1 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>3,4 %</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**

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	40	22	617	579	12	15	577	400
<b>Real</b>	20	198	368	407	22	40	385	422	15	12	289	467
<b>Total</b>	218	218	936	936	62	62	1001	1001	27	27	867	867

\* 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 9 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.