

**Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 11 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\$223,1 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	21,8	37,8	18,8	2,8	40,6
15-35	73,8	81,6	66,6	58,8	140,3
36-60	3,7	0,3	0,3	3,7	4,1
61-90	2,0	0,7	0,7	2,0	2,7
91-180	27,8	0,7	0,7	27,8	28,5
>180	6,9	3,0	0,0	3,9	6,9
<b>Total</b>	<b>136,0</b>	<b>124,1</b>	<b>87,1</b>	<b>99,0</b>	<b>223,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	4,1 %
15-35	3,1 %	3,4 %
36-60	2,7 %	2,4 %
61-90	3,2 %	3,2 %
91-180	3,3 %	3,1 %
>180	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</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**

Sectores	9 al 13 de Octubre				16 al 20 de Octubre				23 al 27 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	41	26	624	583	13	15	653	470	23	12	667	528
<b>Real</b>	26	41	381	422	15	13	309	493	12	23	438	577
<b>Total</b>	66	66	1005	1005	27	27	962	962	35	35	1104	1104

\* 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 12 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.