

**Fecha de Publicación: 25 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 23 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\$236,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,3	32,5	32,5	14,3	46,8
15-35	70,9	31,1	31,1	70,9	102,0
36-60	17,4	4,2	4,2	17,4	21,6
61-90	30,4	5,0	5,0	30,4	35,5
91-180	20,5	2,9	2,9	20,5	23,4
>180	3,9	3,0	3,0	3,9	6,9
<b>Total</b>	<b>157,4</b>	<b>78,7</b>	<b>78,7</b>	<b>157,4</b>	<b>236,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	2,9 %
15-35	2,6 %	2,9 %
36-60	2,8 %	3,9 %
61-90	2,7 %	2,7 %
91-180	2,8 %	2,3 %
>180	3,1 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>2,2 %</b>	<b>2,9 %</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	23 al 27 de Octubre				30 de Oct. al 3 de Noviembre				6 al 10 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	29	16	852	710	19	23	774	739	46	19	301	216
<b>Real</b>	16	29	545	687	23	19	640	675	19	46	193	279
<b>Total</b>	45	45	1397	1397	42	42	1414	1414	65	65	495	495

\* 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.