

**Fecha de Publicación: 30 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 26 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\$327,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,2	46,5	39,5	31,2	77,7
15-35	83,5	64,9	46,9	65,5	130,4
36-60	21,1	4,4	4,4	21,1	25,4
61-90	16,3	3,3	3,3	16,3	19,5
91-180	18,4	47,2	47,2	18,4	65,5
>180	0,2	8,3	8,3	0,2	8,5
<b>Total</b>	<b>177,6</b>	<b>174,6</b>	<b>149,6</b>	<b>152,6</b>	<b>327,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,6 %	5,3 %
15-35	3,3 %	3,2 %
36-60	3,6 %	3,2 %
61-90	3,2 %	3,1 %
91-180	3,2 %	3,2 %
>180	2,9 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,7 %</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>	26	16	855	710	24	23	878	839	48	19	334	277
<b>Real</b>	16	26	545	691	23	24	698	737	19	48	244	301
<b>Total</b>	42	42	1400	1400	46	46	1577	1577	68	68	578	578

\* 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 27 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.