

**Fecha de Publicación: 31 de Octubre de 2006**  
**Fecha de Información: 27 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\$345,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	74,9	62,4	32,4	44,9	107,3
15-35	51,9	88,0	68,0	31,9	119,9
36-60	62,8	1,4	1,4	62,8	64,2
61-90	21,7	2,2	2,2	21,7	23,9
91-180	0,1	12,1	12,1	0,1	12,2
>180	10,1	17,4	7,4	0,1	17,5
<b>Total</b>	<b>221,5</b>	<b>183,5</b>	<b>123,5</b>	<b>161,5</b>	<b>345,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	2,3 %
15-35	4,1 %	4,1 %
36-60	2,8 %	2,4 %
61-90	3,4 %	2,4 %
91-180	3,3 %	3,2 %
>180	3,3 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,0 %</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	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	24	895	870	49	23	391	304
<b>Real</b>	16	26	545	691	24	24	714	739	23	49	256	343
<b>Total</b>	42	42	1400	1400	48	48	1609	1609	71	71	647	647

\* 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 30 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.