

**Fecha de Publicación: 15 de Noviembre de 2006**  
**Fecha de Información: 10 de Noviembre 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\$262,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	29,9	40,6	40,6	29,9	70,5
15-35	90,7	42,1	27,1	75,7	117,7
36-60	1,4	8,7	8,7	1,4	10,2
61-90	22,3	3,1	3,1	22,3	25,3
91-180	3,1	8,0	8,0	3,1	11,1
>180	12,6	15,3	15,3	12,6	27,8
<b>Total</b>	<b>160,0</b>	<b>117,8</b>	<b>102,8</b>	<b>145,0</b>	<b>262,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,6 %	4,4 %
15-35	2,3 %	1,4 %
36-60	3,1 %	2,9 %
61-90	3,6 %	2,5 %
91-180	2,4 %	2,9 %
>180	1,6 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>2,5 %</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	6 al 10 de Noviembre				13 al 17 de Noviembre				20 al 24 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	51	25	490	450	66	16	578	463	70	16	355	340
<b>Real</b>	25	51	381	421	16	66	288	403	16	70	274	289
<b>Total</b>	76	76	871	871	82	82	866	866	86	86	629	629

\* 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 13 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.