

**Fecha de Publicación: 20 de Noviembre de 2006**  
**Fecha de Información: 16 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\$337,5 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	56,9	32,4	32,4	56,9	89,2
15-35	78,2	75,4	55,4	58,2	133,7
36-60	1,0	61,3	61,3	1,0	62,3
61-90	0,7	26,8	26,8	0,7	27,5
91-180	20,7	3,0	3,0	20,7	23,7
>180	0,8	0,3	0,3	0,8	1,1
<b>Total</b>	<b>158,3</b>	<b>199,2</b>	<b>179,2</b>	<b>138,3</b>	<b>337,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,4 %	2,0 %
15-35	3,4 %	3,9 %
36-60	3,6 %	3,9 %
61-90	3,1 %	4,0 %
91-180	3,0 %	3,2 %
>180	2,8 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</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	13 al 17 de Noviembre				20 al 24 de Noviembre				27 de Nov. al 1 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	65	17	592	478	75	23	406	365	63	22	572	445
<b>Real</b>	17	65	303	417	23	75	294	335	22	63	336	462
<b>Total</b>	82	82	894	894	98	98	700	700	85	85	908	908

\* 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 17 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.