

**Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 8 de Septiembre 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\$184,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,7	34,7	23,7	4,7	39,3
15-35	90,9	66,8	44,8	68,9	135,7
36-60	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
61-90	0,5	1,7	1,7	0,5	2,2
91-180	0,5	6,4	6,4	0,5	6,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>107,6</b>	<b>109,6</b>	<b>76,6</b>	<b>74,6</b>	<b>184,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	1,6 %
15-35	2,3 %	1,4 %
36-60	1,8 %	1,8 %
61-90	2,8 %	3,7 %
91-180	3,2 %	3,0 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>1,5 %</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**

Sectores	4 al 8 de Septiembre				11 al 15 de Septiembre				18 al 22 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	15	18	609	546	24	18	901	822	6	16	679	685
<b>Real</b>	18	15	392	456	18	24	641	720	16	6	488	483
<b>Total</b>	33	33	1002	1002	42	42	1542	1542	23	23	1167	1167

\* 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 11 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.