

**Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 12 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\$202,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,1	24,5	24,5	30,1	54,6
15-35	73,5	55,3	47,3	65,5	120,9
36-60	0,3	18,2	18,2	0,3	18,5
61-90	0,4	0,1	0,1	0,4	0,4
91-180	3,1	0,3	0,3	3,1	3,4
>180	2,1	2,5	2,5	2,1	4,6
<b>Total</b>	<b>109,5</b>	<b>100,9</b>	<b>92,9</b>	<b>101,5</b>	<b>202,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,0 %	3,9 %
15-35	2,4 %	2,8 %
36-60	2,9 %	3,5 %
61-90	1,8 %	2,0 %
91-180	3,4 %	3,4 %
>180	3,0 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,2 %</b>	<b>3,2 %</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	11 al 15 de Septiembre				18 al 22 de Septiembre				25 al 29 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	24	18	922	835	8	16	744	745	6	19	715	763
<b>Real</b>	18	24	642	730	16	8	521	520	19	6	648	600
<b>Total</b>	42	42	1564	1564	24	24	1265	1265	25	25	1363	1363

\* 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 septiembre se presenta la proyección de vencimientos.