

**Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 13 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\$441,7 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	56,5	63,4	22,4	15,5	78,9
15-35	195,6	95,3	65,3	165,6	260,9
36-60	17,1	0,1	0,1	17,1	17,3
61-90	30,3	8,0	1,0	23,3	31,3
91-180	10,8	40,5	40,4	10,7	51,2
>180	0,0	2,1	2,1	0,0	2,1
<b>Total</b>	<b>310,3</b>	<b>209,5</b>	<b>131,4</b>	<b>232,3</b>	<b>441,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

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>	25	18	922	835	8	17	793	797	6	19	753	784
<b>Real</b>	18	25	642	730	17	8	532	528	19	6	669	638
<b>Total</b>	43	43	1564	1564	24	24	1325	1325	25	25	1422	1422

\* 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 14 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.