

**Fecha de Publicación: 18 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 14 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\$324,7 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	14,2	22,2	22,2	14,2	36,4
15-35	126,6	120,9	110,9	116,6	237,5
36-60	0,0	0,3	0,3	0,0	0,3
61-90	0,1	5,4	5,4	0,1	5,5
91-180	0,5	33,4	33,3	0,4	33,8
>180	1,5	9,7	9,7	1,5	11,2
<b>Total</b>	<b>142,8</b>	<b>191,9</b>	<b>181,8</b>	<b>132,7</b>	<b>324,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,3 %	4,9 %
15-35	3,4 %	3,2 %
36-60	4,5 %	4,2 %
61-90	3,5 %	3,4 %
91-180	3,7 %	3,4 %
>180	3,6 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</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	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	796	800	11	20	778	834
<b>Real</b>	18	25	643	730	17	8	535	531	20	11	709	653
<b>Total</b>	42	42	1565	1565	26	26	1331	1331	31	31	1487	1487

\* 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 15 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.