

**Fecha de Publicación: 19 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 15 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\$295,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,4	64,9	64,9	45,4	110,4
15-35	102,2	51,2	35,2	86,2	137,4
36-60	0,8	5,5	5,5	0,8	6,3
61-90	0,2	0,6	0,6	0,2	0,7
91-180	0,2	15,6	15,6	0,2	15,8
>180	20,0	4,6	4,6	20,0	24,6
<b>Total</b>	<b>168,8</b>	<b>142,4</b>	<b>126,4</b>	<b>152,8</b>	<b>295,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,5 %	2,9 %
15-35	2,2 %	2,4 %
36-60	3,1 %	1,9 %
61-90	3,5 %	2,9 %
91-180	3,1 %	2,9 %
>180	3,3 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,6 %</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	9	17	800	852	11	21	820	846
<b>Real</b>	18	25	642	730	17	9	587	535	21	11	721	695
<b>Total</b>	42	42	1565	1565	26	26	1387	1387	32	32	1541	1541

\* 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 18 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.