

**Fecha de Publicación: 25 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 21 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\$395,6 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	98,7	39,7	39,7	98,7	138,4
15-35	61,8	187,1	156,1	30,8	217,8
36-60	1,2	7,2	7,2	1,2	8,4
61-90	4,8	1,1	1,1	4,8	5,9
91-180	1,8	2,0	2,0	1,8	3,7
>180	5,3	15,9	15,9	5,3	21,2
<b>Total</b>	<b>173,6</b>	<b>253,0</b>	<b>222,0</b>	<b>142,6</b>	<b>395,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,6 %	4,6 %
15-35	2,7 %	2,7 %
36-60	2,6 %	2,6 %
61-90	2,4 %	2,7 %
91-180	2,2 %	2,3 %
>180	2,6 %	3,1 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</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	18 al 22 de Septiembre				25 al 29 de Septiembre				2 al 6 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	9	22	876	902	13	19	941	938	50	18	445	343
<b>Real</b>	22	9	615	589	19	13	783	787	18	50	257	359
<b>Total</b>	31	31	1491	1491	32	32	1725	1725	69	69	702	702

\* 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 22 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.