

**Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 22 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\$208,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,6	50,3	50,3	44,6	94,9
15-35	79,1	10,0	7,0	76,1	86,1
36-60	1,6	0,1	0,1	1,6	1,6
61-90	1,2	0,7	0,7	1,2	1,9
91-180	22,3	0,1	0,1	22,3	22,3
>180	1,9	0,0	0,0	1,9	1,9
<b>Total</b>	<b>150,6</b>	<b>61,1</b>	<b>58,1</b>	<b>147,6</b>	<b>208,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,6 %	1,5 %
15-35	2,0 %	1,4 %
36-60	2,3 %	3,2 %
61-90	2,6 %	2,7 %
91-180	3,2 %	2,9 %
>180	2,4 %	2,5 %
<b>Total</b>	<b>0,7 %</b>	<b>1,7 %</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	903	14	21	954	966	75	19	451	362
<b>Real</b>	22	9	615	589	21	14	812	800	19	75	276	365
<b>Total</b>	31	31	1491	1491	34	34	1766	1766	94	94	727	727

\* 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 25 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.