

**Fecha de Publicación: 27 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 25 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\$274,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97,0	50,6	50,6	97,0	147,6
15-35	72,9	55,7	46,7	63,9	119,7
36-60	0,3	5,1	5,1	0,3	5,4
61-90	0,9	0,2	0,2	0,9	1,1
91-180	0,7	0,2	0,2	0,7	0,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>171,9</b>	<b>111,8</b>	<b>102,8</b>	<b>162,9</b>	<b>274,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	0,9 %
15-35	2,4 %	2,4 %
36-60	2,7 %	3,8 %
61-90	3,2 %	2,9 %
91-180	3,0 %	2,9 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>1,6 %</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	25 al 29 de Septiembre				2 al 6 de Octubre				9 al 13 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	14	21	982	991	126	19	469	389	28	15	433	379
<b>Real</b>	21	14	837	828	19	126	302	383	15	28	312	366
<b>Total</b>	35	35	1819	1819	145	145	771	771	43	43	746	746

\* 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 26 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.