

**Fecha de Publicación: 6 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 4 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\$254,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,6	59,7	43,7	33,6	93,3
15-35	65,5	33,7	22,7	54,5	88,2
36-60	21,6	22,0	22,0	21,6	43,5
61-90	1,0	2,2	2,2	1,0	3,2
91-180	18,7	5,8	5,8	18,7	24,5
>180	0,0	2,0	2,0	0,0	2,0
<b>Total</b>	<b>156,4</b>	<b>125,3</b>	<b>98,3</b>	<b>129,4</b>	<b>254,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,1 %	6,1 %
15-35	3,6 %	2,5 %
36-60	3,0 %	2,5 %
61-90	3,4 %	3,6 %
91-180	3,3 %	2,3 %
>180	3,0 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,8 %</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**

Sector	4 al 8 de Septiembre				11 al 15 de Septiembre				18 al 22 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	15	18	607	544	19	18	766	695	4	16	603	571
<b>Real</b>	17	15	391	454	18	19	583	654	16	4	431	463
<b>Total</b>	33	33	999	999	37	37	1349	1349	20	20	1034	1034

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 5 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.