

**Fecha de Publicación: 8 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 6 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\$197,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	91,0	77,0	19,0	33,0	110,0
15-35	27,2	68,2	53,2	12,2	80,5
36-60	0,0	1,7	1,7	0,0	1,7
61-90	0,1	1,3	1,3	0,1	1,4
91-180	0,5	1,8	1,8	0,5	2,3
>180	0,0	2,1	2,1	0,0	2,1
<b>Total</b>	<b>118,8</b>	<b>152,0</b>	<b>79,0</b>	<b>45,8</b>	<b>197,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,8 %	4,2 %
15-35	3,4 %	3,9 %
36-60	3,1 %	4,2 %
61-90	3,3 %	3,4 %
91-180	3,4 %	3,1 %
>180	3,9 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,1 %</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	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	609	545	19	17	846	764	5	16	644	632
<b>Real</b>	18	15	392	456	17	19	615	697	16	5	467	479
<b>Total</b>	33	33	1002	1002	37	37	1461	1461	21	21	1111	1111

\* 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 7 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.