

**Fecha de Publicación: 25 de Julio de 2006**  
**Fecha de Información: 21 de Julio 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\$383,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,2	15,5	15,5	15,2	30,7
15-35	111,6	124,4	96,4	83,6	208,0
36-60	64,5	7,7	7,7	64,5	72,2
61-90	1,6	9,8	9,8	1,6	11,5
91-180	20,0	15,6	15,6	20,0	35,6
>180	7,5	18,0	18,0	7,5	25,5
<b>Total</b>	<b>220,4</b>	<b>191,0</b>	<b>163,0</b>	<b>192,4</b>	<b>383,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	-3,8 %
15-35	1,9 %	0,0 %
36-60	2,5 %	0,9 %
61-90	3,4 %	2,5 %
91-180	4,2 %	2,6 %
>180	2,8 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>0,3 %</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	17 al 21 de Julio				24 al 28 de Julio				31 de Jul. al 4 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	10	20	332	495	12	43	645	669	2	31	378	370
<b>Real</b>	20	10	401	238	43	12	452	427	31	2	227	235
<b>Total</b>	30	30	733	733	55	55	1096	1096	33	33	605	605

\* 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 24 de julio se presenta la proyección de vencimientos.