

**Fecha de Publicación: 28 de Julio de 2006**  
**Fecha de Información: 26 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\$234,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,7	12,6	12,6	32,7	45,3
15-35	50,7	137,1	104,1	17,7	154,8
36-60	0,0	0,5	0,5	0,0	0,5
61-90	0,3	0,4	0,4	0,3	0,7
91-180	29,9	3,4	3,3	29,8	33,2
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>113,6</b>	<b>154,0</b>	<b>120,9</b>	<b>80,5</b>	<b>234,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,7 %	-0,5 %
15-35	2,9 %	1,7 %
36-60	5,4 %	6,1 %
61-90	2,5 %	3,0 %
91-180	2,3 %	1,2 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>1,2 %</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	24 al 28 de Julio				31 de Jul. al 4 de Agosto				7 al 11 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	13	46	667	687	5	31	413	398	4	39	382	367
<b>Real</b>	46	13	465	445	31	5	256	270	39	4	252	267
<b>Total</b>	59	59	1132	1132	37	37	668	668	43	43	634	634

\* 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 27 de julio se presenta la proyección de vencimientos.