

**Fecha de Publicación: 31 de Julio de 2006**  
**Fecha de Información: 27 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\$293,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,0	22,4	22,4	76,0	98,4
15-35	95,2	37,8	37,7	95,1	132,9
36-60	21,0	41,0	21,0	1,0	42,0
61-90	1,0	5,3	5,3	1,0	6,3
91-180	3,0	6,8	6,8	3,0	9,8
>180	0,0	4,2	4,2	0,0	4,2
<b>Total</b>	<b>196,2</b>	<b>117,4</b>	<b>97,3</b>	<b>176,1</b>	<b>293,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,2 %	3,6 %
15-35	2,4 %	1,5 %
36-60	2,6 %	1,3 %
61-90	2,3 %	2,6 %
91-180	2,7 %	2,3 %
>180	2,6 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,3 %</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	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	45	667	688	7	34	451	412	4	39	417	373
<b>Real</b>	45	13	466	445	34	7	269	308	39	4	258	302
<b>Total</b>	58	58	1132	1132	41	41	720	720	44	44	675	675

\* 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 28 de julio se presenta la proyección de vencimientos.