

**Fecha de Publicación: 1 de Agosto de 2006**  
**Fecha de Información: 28 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\$395,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,7	71,2	57,2	1,7	73,0
15-35	154,9	113,2	41,5	83,2	196,5
36-60	0,3	13,5	13,5	0,3	13,7
61-90	0,8	6,8	6,8	0,8	7,6
91-180	86,6	3,9	3,9	86,6	90,4
>180	13,0	2,7	1,7	12,0	14,7
<b>Total</b>	<b>271,2</b>	<b>211,3</b>	<b>124,6</b>	<b>184,5</b>	<b>395,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,7 %	1,3 %
15-35	2,5 %	1,7 %
36-60	3,5 %	2,2 %
61-90	6,1 %	2,6 %
91-180	5,6 %	1,7 %
>180	2,4 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>1,6 %</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	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	48	667	689	7	31	459	425	5	39	424	432
<b>Real</b>	48	13	467	445	31	7	275	309	39	5	310	302
<b>Total</b>	61	61	1133	1133	38	38	734	734	44	44	735	735

\* 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 31 de julio se presenta la proyección de vencimientos.