

**Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2006**  
**Fecha de Información: 16 de Agosto 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\$331,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,9	18,3	17,3	44,9	63,2
15-35	92,6	137,9	118,9	73,6	211,4
36-60	0,0	2,7	2,7	0,0	2,7
61-90	0,0	2,7	2,7	0,0	2,7
91-180	0,1	15,0	15,0	0,1	15,1
>180	0,0	36,1	36,1	0,0	36,1
<b>Total</b>	<b>138,5</b>	<b>212,6</b>	<b>192,6</b>	<b>118,5</b>	<b>331,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,9 %	9,8 %
15-35	2,5 %	1,0 %
36-60	3,6 %	3,6 %
61-90	2,8 %	2,7 %
91-180	2,6 %	2,6 %
>180	2,4 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>2,9 %</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	14 al 18 de Agosto				21 al 25 de Agosto				28 de Ago. al 1 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	18	56	505	625	7	76	755	670	17	23	745	537
<b>Real</b>	56	18	483	362	76	7	474	559	23	17	347	556
<b>Total</b>	74	74	988	988	83	83	1229	1229	40	40	1092	1092

\* 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 17 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.