

**Fecha de Publicación: 22 de Agosto de 2006**  
**Fecha de Información: 17 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\$306,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,8	20,9	15,9	57,8	78,8
15-35	107,1	99,0	79,0	87,1	186,1
36-60	0,1	0,3	0,3	0,1	0,4
61-90	1,2	5,4	5,4	1,2	6,6
91-180	0,5	2,0	2,0	0,5	2,5
>180	1,1	30,5	30,5	1,1	31,7
<b>Total</b>	<b>172,8</b>	<b>158,2</b>	<b>133,2</b>	<b>147,8</b>	<b>306,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	4,1 %
15-35	1,9 %	1,9 %
36-60	1,6 %	2,6 %
61-90	2,6 %	3,0 %
91-180	1,6 %	2,4 %
>180	2,0 %	2,2 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,6 %</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	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	55	505	626	8	76	791	685	18	23	770	560
<b>Real</b>	55	18	484	362	76	8	489	595	23	18	365	576
<b>Total</b>	73	73	989	989	84	84	1280	1280	41	41	1136	1136

\* 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 18 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.