

**Fecha de Publicación: 2 de Junio de 2006**  
**Fecha de Información: 31 de Mayo 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\$122,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11,0	12,5	7,5	6,0	18,4
15-35	47,7	42,9	34,3	39,1	82,0
36-60	1,0	1,1	0,1	0,0	1,1
61-90	15,0	10,0	0,0	5,0	15,0
91-180	2,2	2,5	2,5	2,2	4,7
>180	0,5	0,4	0,4	0,5	0,9
<b>Total</b>	<b>77,4</b>	<b>69,4</b>	<b>44,8</b>	<b>52,8</b>	<b>122,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,3 %	4,9 %
15-35	0,8 %	0,6 %
36-60	-0,1 %	0,4 %
61-90	1,0 %	0,9 %
91-180	0,2 %	0,6 %
>180	0,3 %	1,0 %
<b>Total</b>	<b>1,4 %</b>	<b>1,3 %</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	29 de May. al 2 de Junio				5 al 9 de Junio				12 al 16 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	10	75	690	608	8	95	729	643	17	43	687	857
<b>Real</b>	75	10	410	492	94	8	314	400	43	17	552	382
<b>Total</b>	85	85	1100	1100	103	103	1043	1043	60	60	1239	1239

\* 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 1 de junio se presenta la proyección de vencimientos.