

**Fecha de Publicación: 05 de Abril de 2006**  
**Fecha de Información: 03 de Abril 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\$203,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,3%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero |             | Sector Real |              | Total        |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|--------------|--------------|
|              | Compras           | Ventas      | Compras     | Ventas       |              |
| 3-14         | 1,3               | 0,1         | 0,1         | 1,3          | 1,4          |
| 15-35        | 152,2             | 45,3        | 39,3        | 146,2        | 191,5        |
| 36-60        | 2,0               | 0,2         | 0,2         | 2,0          | 2,1          |
| 61-90        | 1,8               | 0,0         | 0,0         | 1,8          | 1,8          |
| 91-180       | 1,3               | 5,2         | 5,2         | 1,3          | 6,5          |
| >180         | 0,0               | 0,0         | 0,0         | 0,0          | 0,0          |
| <b>Total</b> | <b>158,6</b>      | <b>50,8</b> | <b>44,8</b> | <b>152,6</b> | <b>203,4</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14         | -5,8 %          | 1,2 %                        |
| 15-35        | -0,1 %          | 0,3 %                        |
| 36-60        | -0,3 %          | -0,2 %                       |
| 61-90        | 0,4 %           | 0,2 %                        |
| 91-180       | 0,5 %           | 0,4 %                        |
| >180         | 1,3 %           | 1,3 %                        |
| <b>Total</b> | <b>-0,7 %</b>   | <b>0,3 %</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          | 10 al 14 de Abril |    |     |     | 17 al 21 de Abril |     |     |     | 3 al 7 de Abril |     |     |     |
|-------------------|-------------------|----|-----|-----|-------------------|-----|-----|-----|-----------------|-----|-----|-----|
|                   | Delivery          |    | NDF |     | Delivery          |     | NDF |     | Delivery        |     | NDF |     |
|                   | C                 | V  | C   | V   | C                 | V   | C   | V   | C               | V   | C   | V   |
| <b>Financiero</b> | 4                 | 52 | 316 | 307 | 14                | 109 | 442 | 377 | 11              | 188 | 594 | 364 |
| <b>Real</b>       | 52                | 4  | 222 | 231 | 109               | 14  | 203 | 267 | 188             | 11  | 99  | 329 |
| <b>Total</b>      | 56                | 56 | 538 | 538 | 123               | 123 | 645 | 645 | 199             | 199 | 693 | 693 |

\* 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 4 de abril se presenta la proyección de vencimientos.