

Fecha de Publicación: 02 de Mayo de 2006  
 Fecha de Información: 27 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\$301,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,0	1,8	1,8	4,0	5,8
15-35	69,7	115,4	80,4	34,7	150,1
36-60	53,9	26,6	23,6	50,9	77,6
61-90	57,2	3,1	3,1	57,2	60,3
91-180	1,8	5,0	4,0	0,8	5,8
>180	0,2	1,6	1,6	0,2	1,7
<b>Total</b>	<b>186,8</b>	<b>153,5</b>	<b>114,5</b>	<b>147,8</b>	<b>301,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	-3,3 %
15-35	2,8 %	1,0 %
36-60	1,4 %	0,7 %
61-90	1,1 %	-0,1 %
91-180	1,2 %	1,9 %
>180	3,0 %	5,6 %
<b>Total</b>	<b>2,0 %</b>	<b>0,7 %</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 Abril				1 al 5 de Mayo				8 al 12 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	17	94	1028	893	8	65	844	470	9	38	417	416
<b>Real</b>	94	17	589	724	65	8	201	574	38	9	232	233
<b>Total</b>	111	111	1617	1617	74	74	1044	1044	47	47	649	649

\* 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 28 de abril se presenta la proyección de vencimientos.