

**Fecha de Publicación: 05 de Junio de 2006**  
**Fecha de Información: 01 de Junio 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\$153,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,6%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero |             | Sector Real |             | Total        |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
|              | Compras           | Ventas      | Compras     | Ventas      |              |
| 3-14         | 18,6              | 14,7        | 6,7         | 10,6        | 25,3         |
| 15-35        | 64,9              | 51,1        | 49,1        | 62,9        | 113,9        |
| 36-60        | 0,0               | 0,5         | 0,5         | 0,0         | 0,5          |
| 61-90        | 3,0               | 5,1         | 5,1         | 3,0         | 8,1          |
| 91-180       | 0,0               | 0,3         | 0,3         | 0,0         | 0,4          |
| >180         | 0,0               | 5,5         | 5,5         | 0,0         | 5,5          |
| <b>Total</b> | <b>86,5</b>       | <b>77,2</b> | <b>67,2</b> | <b>76,5</b> | <b>153,7</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14         | -0,3 %          | -1,5 %                       |
| 15-35        | 0,5 %           | 1,0 %                        |
| 36-60        | -14,9 %         | 1,7 %                        |
| 61-90        | 1,0 %           | 1,1 %                        |
| 91-180       | 1,7 %           | 1,7 %                        |
| >180         | 1,0 %           | 1,6 %                        |
| <b>Total</b> | <b>-0,1 %</b>   | <b>0,6 %</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            | 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  | 10              | 93  | 744  | 656  | 17                | 42 | 688  | 871  |
| <b>Real</b>       | 75                       | 10 | 410  | 492  | 93              | 10  | 318  | 407  | 42                | 17 | 566  | 383  |
| <b>Total</b>      | 86                       | 86 | 1100 | 1100 | 103             | 103 | 1063 | 1063 | 59                | 59 | 1254 | 1254 |

\* 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 2 de junio se presenta la proyección de vencimientos.