

Fecha de Publicación: 10 de Abril de 2007

Fecha de Información: 4 de Abril de 2007 <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\$189,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,6	16,1	0,1	11,6	27,7
15-35	26,8	71,1	60,1	15,8	86,8
36-60	10,0	19,1	9,1	0,0	19,1
61-90	30,5	14,4	14,4	30,5	44,9
91-180	10,0	10,4	0,4	0,0	10,4
>180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
<b>Total</b>	<b>104,9</b>	<b>132,0</b>	<b>85,0</b>	<b>57,9</b>	<b>189,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,9 %	-1,7 %
15-35	-1,1 %	-1,0 %
36-60	0,6 %	0,1 %
61-90	1,5 %	0,8 %
91-180	2,0 %	0,7 %
>180	3,3 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>0,1 %</b>	<b>-0,5 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

<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 5 de abril se presenta la proyección de vencimientos.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	18	10	812	845	49	39	933	730	3	28	513	466
<b>Real</b>	10	18	643	610	39	49	550	753	28	3	390	437
<b>Total</b>	28	28	1455	1455	88	88	1484	1484	31	31	903	903

\* Cifras en millones de dólares