

Fecha de Publicación: 18 de Abril de 2007  
 Fecha de Información: 16 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\$582,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	136,2	133,9	63,9	66,2	200,1
15-35	124,3	102,4	45,4	67,3	169,7
36-60	113,4	47,9	22,9	88,4	136,3
61-90	10,3	13,9	13,9	10,3	24,2
91-180	1,6	27,0	27,0	1,6	28,5
>180	20,1	3,8	3,8	20,1	23,8
<b>Total</b>	<b>405,7</b>	<b>328,9</b>	<b>176,9</b>	<b>253,7</b>	<b>582,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,8 %	0,8 %
15-35	0,1 %	0,4 %
36-60	1,0 %	1,5 %
61-90	1,5 %	1,6 %
91-180	2,3 %	1,5 %
>180	2,8 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>0,3 %</b>	<b>1,0 %</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	16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	10	28	676	613	4	46	1032	781	0	113	476	465
<b>Real</b>	28	10	501	564	46	4	474	725	113	0	412	423
<b>Total</b>	38	38	1177	1177	50	50	1506	1506	114	114	888	888

\* 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 17 de abril se presenta la proyección de vencimientos.