

**Fecha de Publicación: 30 de Abril de 2007**  
**Fecha de Información: 26 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\$278,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero |              | Sector Real  |              | Total        |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|              | Compras           | Ventas       | Compras      | Ventas       |              |
| 3-14         | 16,8              | 18,5         | 18,5         | 16,8         | 35,3         |
| 15-35        | 89,2              | 128,1        | 93,1         | 54,2         | 182,3        |
| 36-60        | 7,7               | 5,2          | 5,2          | 7,7          | 12,9         |
| 61-90        | 1,5               | 3,6          | 3,6          | 1,5          | 5,0          |
| 91-180       | 21,8              | 11,3         | 11,1         | 21,5         | 32,8         |
| >180         | 5,0               | 5,1          | 5,1          | 5,0          | 10,1         |
| <b>Total</b> | <b>141,8</b>      | <b>171,8</b> | <b>136,6</b> | <b>106,6</b> | <b>278,4</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14         | 0,5 %           | 0,8 %                        |
| 15-35        | 0,2 %           | 1,1 %                        |
| 36-60        | 1,5 %           | 1,0 %                        |
| 61-90        | 1,9 %           | 1,7 %                        |
| 91-180       | -0,1 %          | 1,8 %                        |
| >180         | 3,0 %           | 3,0 %                        |
| <b>Total</b> | <b>0,3 %</b>    | <b>1,2 %</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            | 23 al 27 de Abril |    |      |      | 30 de Abr. al 4 de Mayo |     |      |      | 7 al 11 de Mayo |     |     |     |
|-------------------|-------------------|----|------|------|-------------------------|-----|------|------|-----------------|-----|-----|-----|
|                   | Delivery          |    | NDF  |      | Delivery                |     | NDF  |      | Delivery        |     | NDF |     |
|                   | C                 | V  | C    | V    | C                       | V   | C    | V    | C               | V   | C   | V   |
| <b>Financiero</b> | 9                 | 45 | 1154 | 971  | 1                       | 115 | 673  | 727  | 4               | 96  | 295 | 363 |
| <b>Real</b>       | 45                | 9  | 643  | 827  | 115                     | 1   | 631  | 577  | 96              | 4   | 284 | 216 |
| <b>Total</b>      | 54                | 54 | 1797 | 1797 | 116                     | 116 | 1304 | 1304 | 100             | 100 | 579 | 579 |

\* 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 27 de abril se presenta la proyección de vencimientos.