

Fecha de Publicación: 2 de Mayo de 2007  
 Fecha de Información: 27 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\$176,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7,0	18,6	18,6	7,0	25,7
15-35	43,2	64,1	52,1	31,2	95,4
36-60	7,6	6,2	6,2	7,6	13,8
61-90	9,3	6,5	6,5	9,3	15,9
91-180	1,0	2,9	2,9	1,0	3,9
>180	17,0	12,0	5,0	10,0	22,0
<b>Total</b>	<b>85,3</b>	<b>110,4</b>	<b>91,4</b>	<b>66,3</b>	<b>176,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,5 %	0,6 %
15-35	0,4 %	0,1 %
36-60	0,8 %	0,8 %
61-90	1,6 %	2,5 %
91-180	2,2 %	2,1 %
>180	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>0,9 %</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	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
Financiero	9	45	1154	971	4	115	675	742	6	98	295	364
Real	45	9	643	827	115	4	646	579	98	6	285	217
<b>Total</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>1797</b>	<b>1797</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>1321</b>	<b>1321</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>580</b>	<b>580</b>

\* 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 30 de abril se presenta la proyección de vencimientos.