

Fecha de Publicación: 3 de Mayo de 2007  
 Fecha de Información: 2 de Mayo 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\$299,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,5	30,1	30,1	26,5	56,6
15-35	97,3	122,7	101,7	76,3	199,0
36-60	0,0	1,8	1,8	0,0	1,8
61-90	10,1	1,4	1,4	10,1	11,5
91-180	12,7	15,6	15,6	12,7	28,3
>180	0,0	1,7	1,7	0,0	1,7
<b>Total</b>	<b>146,6</b>	<b>173,4</b>	<b>152,4</b>	<b>125,6</b>	<b>299,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,0 %	8,4 %
15-35	-0,4 %	-0,6 %
36-60	1,2 %	2,1 %
61-90	1,1 %	-0,5 %
91-180	2,0 %	1,3 %
>180	3,1 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>1,3 %</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	30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	5	104	677	760	7	95	332	404	10	67	649	624
Real	104	5	664	581	95	7	316	243	67	10	466	490
<b>Total</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>1341</b>	<b>1341</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>648</b>	<b>648</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>1114</b>	<b>1114</b>

\* 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 3 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.