

Fecha de Publicación: 19 de Mayo de 2007  
 Fecha de Información: 17 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\$218,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,2	53,1	53,1	32,2	85,3
15-35	28,3	51,0	46,0	23,3	74,3
36-60	1,2	14,6	14,6	1,2	15,9
61-90	4,6	13,5	13,5	4,6	18,0
91-180	3,4	10,9	10,9	3,4	14,3
>180	1,8	8,3	8,3	1,8	10,1
<b>Total</b>	<b>71,6</b>	<b>151,3</b>	<b>146,3</b>	<b>66,6</b>	<b>218,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,3 %	2,9 %
15-35	1,6 %	2,3 %
36-60	1,0 %	3,1 %
61-90	1,8 %	2,3 %
91-180	2,4 %	2,3 %
>180	3,1 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>2,0 %</b>	<b>2,6 %</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	14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	17	52	770	811	12	83	612	669	3	169	770	645
Real	52	17	644	603	83	12	556	500	169	3	480	605
<b>Total</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>1414</b>	<b>1414</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>1168</b>	<b>1168</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>1250</b>	<b>1250</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 18 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.