

**Fecha de Publicación: 1 de Marzo de 2007**  
**Fecha de Información: 27 de Febrero 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\$484,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,2	65,6	44,1	25,7	91,3
15-35	148,2	170,4	160,4	138,2	308,6
36-60	23,5	4,8	4,8	23,5	28,3
61-90	14,2	2,6	2,6	14,2	16,8
91-180	4,7	19,3	19,3	4,7	24,1
>180	3,0	12,1	12,1	3,0	15,1
<b>Total</b>	<b>240,9</b>	<b>274,8</b>	<b>243,3</b>	<b>209,4</b>	<b>484,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,0 %	8,3 %
15-35	2,9 %	3,3 %
36-60	3,3 %	3,2 %
61-90	2,3 %	2,4 %
91-180	1,1 %	3,2 %
>180	2,8 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>4,2 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

<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 28 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	26 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	47	44	952	831	40	26	583	725	26	25	622	433
<b>Real</b>	44	47	704	824	26	40	537	396	25	26	313	502
<b>Total</b>	91	91	1656	1656	66	66	1120	1120	52	52	935	935

\* Cifras en millones de dólares