

Fecha de Publicación: 7 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 5 de Marzo 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\$263,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,1	43,2	43,2	18,1	61,3
15-35	71,2	51,7	38,0	57,5	109,2
36-60	1,5	2,6	2,6	1,5	4,1
61-90	0,4	27,4	27,4	0,4	27,8
91-180	2,9	37,3	37,3	2,9	40,3
>180	20,5	0,0	0,0	20,5	20,5
<b>Total</b>	<b>114,7</b>	<b>162,2</b>	<b>148,5</b>	<b>101,0</b>	<b>263,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	3,9 %
15-35	2,8 %	2,4 %
36-60	3,2 %	2,7 %
61-90	3,5 %	3,0 %
91-180	3,0 %	3,1 %
>180	2,8 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,9 %</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 6 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	43	27	781	958	30	25	715	568	45	20	371	459
<b>Real</b>	27	43	732	554	25	30	446	593	20	45	420	331
<b>Total</b>	70	70	1512	1512	55	55	1161	1161	64	64	790	790

\* Cifras en millones de dólares