

Fecha de Publicación: 9 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 7 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\$274,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,3	30,2	25,2	8,3	38,5
15-35	95,0	110,1	95,1	80,0	190,2
36-60	22,3	0,6	0,6	22,3	22,9
61-90	12,0	1,8	1,8	12,0	13,8
91-180	0,4	7,3	7,3	0,4	7,7
>180	0,0	1,3	1,3	0,0	1,3
<b>Total</b>	<b>143,0</b>	<b>151,3</b>	<b>131,3</b>	<b>123,0</b>	<b>274,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,3 %	3,0 %
15-35	3,3 %	3,1 %
36-60	3,7 %	3,4 %
61-90	3,4 %	2,7 %
91-180	3,4 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,1 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 8 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>	44	26	806	977	30	26	753	637	45	21	403	487
<b>Real</b>	26	44	733	561	26	30	495	611	21	45	446	362
<b>Total</b>	70	70	1539	1539	56	56	1248	1248	66	66	849	849

\* Cifras en millones de dólares