

Fecha de Publicación: 13 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 09 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\$217,2 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	20,2	62,3	57,3	15,2	77,5
15-35	79,1	57,7	37,7	59,1	116,8
36-60	0,0	4,0	4,0	0,0	4,0
61-90	0,0	2,7	2,7	0,0	2,7
91-180	5,1	10,1	10,1	5,1	15,2
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
<b>Total</b>	<b>104,4</b>	<b>137,8</b>	<b>112,8</b>	<b>79,4</b>	<b>217,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,3 %	5,3 %
15-35	3,5 %	3,6 %
36-60	3,6 %	3,1 %
61-90	3,5 %	3,1 %
91-180	3,6 %	3,4 %
>180	3,1 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</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 12 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sectores	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	26	806	978	29	27	772	692	60	22	457	528
<b>Real</b>	26	43	733	561	27	29	543	623	22	60	467	396
<b>Total</b>	69	69	1539	1539	56	56	1315	1315	82	82	924	924

\* Cifras en millones de dólares