

Fecha de Publicación: 22 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 20 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\$453,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	127,4	106,4	100,4	121,4	227,8
15-35	91,8	94,3	89,3	86,8	181,2
36-60	8,4	23,5	18,5	3,4	26,9
61-90	0,5	0,9	0,9	0,5	1,4
91-180	0,0	7,9	7,9	0,0	7,9
>180	0,0	7,9	7,9	0,0	7,9
<b>Total</b>	<b>228,1</b>	<b>240,9</b>	<b>224,9</b>	<b>212,1</b>	<b>453,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	1,8 %
15-35	3,3 %	4,5 %
36-60	3,8 %	2,6 %
61-90	3,9 %	3,4 %
91-180	3,7 %	3,4 %
>180	3,4 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,0 %</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 21 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	115	24	650	664	36	25	848	729	48	12	497	668
<b>Real</b>	24	115	568	554	25	36	605	724	12	48	570	399
<b>Total</b>	139	139	1218	1218	61	61	1453	1453	60	60	1066	1066

\* Cifras en millones de dólares