

Fecha de Publicación: 26 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 22 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\$535,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,3	56,8	34,8	45,3	102,2
15-35	214,0	106,6	85,6	193,0	299,6
36-60	7,3	0,8	0,8	7,3	8,1
61-90	0,4	5,2	5,2	0,4	5,6
91-180	0,3	8,5	8,5	0,3	8,8
>180	53,0	58,5	58,5	53,0	111,5
<b>Total</b>	<b>342,4</b>	<b>236,4</b>	<b>193,4</b>	<b>299,4</b>	<b>535,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,2 %	-0,3 %
15-35	2,4 %	2,5 %
36-60	3,0 %	3,1 %
61-90	3,1 %	2,6 %
91-180	3,6 %	3,6 %
>180	3,4 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,1 %</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:  $((Tasa\ Pactada / Promedio\ SET\ FX) ^ (365 / Plazo)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 23 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>	116	24	650	664	40	25	884	791	48	13	537	697
<b>Real</b>	24	116	568	554	25	40	666	760	13	48	577	417
<b>Total</b>	140	140	1218	1218	66	66	1551	1551	61	61	1113	1113

\* Cifras en millones de dólares