

Fecha de Publicación: 28 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 26 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\$217,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,7	19,7	15,7	33,7	53,4
15-35	73,0	75,6	39,6	37,0	112,6
36-60	0,0	26,2	26,2	0,0	26,2
61-90	0,0	9,9	9,9	0,0	9,9
91-180	1,6	3,9	3,9	1,6	5,5
>180	5,0	5,2	5,2	5,0	10,2
<b>Total</b>	<b>117,3</b>	<b>140,5</b>	<b>100,5</b>	<b>77,3</b>	<b>217,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,7 %	-1,9 %
15-35	2,4 %	2,9 %
36-60	3,1 %	2,8 %
61-90	3,4 %	3,0 %
91-180	3,2 %	3,1 %
>180	3,3 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>1,7 %</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 27 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	42	28	909	848	48	13	596	717	34	38	823	499
<b>Real</b>	28	42	719	781	13	48	582	461	38	34	358	682
<b>Total</b>	70	70	1629	1629	61	61	1178	1178	72	72	1181	1181

\* Cifras en millones de dólares