

Fecha de Publicación: 30 de Marzo de 2007  
 Fecha de Información: 28 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\$349,1 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	41,7	39,3	19,3	21,7	61,0
15-35	49,1	184,4	174,4	39,1	223,5
36-60	0,2	2,2	2,2	0,2	2,4
61-90	0,0	0,4	0,4	0,0	0,4
91-180	26,3	37,4	32,4	21,3	58,7
>180	0,0	3,0	3,0	0,0	3,0
<b>Total</b>	<b>117,4</b>	<b>266,7</b>	<b>231,7</b>	<b>82,4</b>	<b>349,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,5 %	9,7 %
15-35	3,4 %	3,1 %
36-60	2,3 %	3,5 %
61-90	1,7 %	1,4 %
91-180	2,8 %	3,0 %
>180	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</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 29 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	27	940	894	49	13	698	815	34	38	853	571
<b>Real</b>	27	42	745	792	13	49	620	503	38	34	418	699
<b>Total</b>	69	69	1685	1685	62	62	1318	1318	72	72	1271	1271

\* Cifras en millones de dólares