

Fecha de Publicación: 2 de Abril de 2007  
 Fecha de Información: 29 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\$607,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,9	24,3	24,3	64,9	89,1
15-35	221,6	254,0	177,0	144,6	398,6
36-60	0,2	8,0	8,0	0,2	8,2
61-90	67,6	17,2	10,2	60,6	77,7
91-180	13,2	25,7	15,7	3,2	28,9
>180	0,0	5,4	5,4	0,0	5,4
<b>Total</b>	<b>367,4</b>	<b>334,5</b>	<b>240,5</b>	<b>273,4</b>	<b>607,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,3 %	10,1 %
15-35	2,7 %	1,9 %
36-60	3,0 %	4,9 %
61-90	1,7 %	1,9 %
91-180	2,9 %	2,5 %
>180	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,2 %</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 30 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>	43	27	940	894	49	13	763	827	35	38	853	613
<b>Real</b>	27	43	745	792	13	49	632	568	38	35	459	699
<b>Total</b>	69	69	1685	1685	62	62	1395	1395	73	73	1312	1312

\* Cifras en millones de dólares