

Fecha de Publicación: 26 de Enero de 2007  
 Fecha de Información: 24 de Enero 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\$255,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,1	47,3	21,8	13,6	60,9
15-35	86,6	128,0	86,0	44,6	172,5
36-60	0,1	0,5	0,5	0,1	0,6
61-90	7,9	1,1	1,1	7,9	9,0
91-180	10,0	10,7	0,7	0,0	10,7
>180	0,4	1,0	1,0	0,4	1,4
<b>Total</b>	<b>144,1</b>	<b>188,6</b>	<b>111,1</b>	<b>66,6</b>	<b>255,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	2,2 %
15-35	1,5 %	1,3 %
36-60	2,2 %	2,6 %
61-90	2,2 %	2,0 %
91-180	3,3 %	2,8 %
>180	2,7 %	2,7 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>1,6 %</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 25 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sectores	5 al 9 de Febrero				22 al 26 de Enero				29 de Ene. al 2 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	25	17	624	612	72	28	738	857	32	35	885	
<b>Real</b>	17	25	513	524	28	72	634	515	35	32	400	
<b>Total</b>	42	42	1136	1136	100	100	1372	1372	67	67	1286	1

\* Cifras en millones de dólares