

**Fecha de Publicación: 18 de Enero de 2007**  
**Fecha de Información: 16 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\$265,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	56,2	20,4	15,4	51,2	71,6
15-35	67,6	83,9	73,4	57,1	140,9
36-60	12,2	6,2	6,2	12,2	18,3
61-90	6,1	13,3	13,3	6,1	19,4
91-180	0,1	0,2	0,2	0,1	0,3
>180	15,0	0,0	0,0	15,0	15,0
<b>Total</b>	<b>157,2</b>	<b>124,0</b>	<b>108,5</b>	<b>141,7</b>	<b>265,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,4 %	1,9 %
15-35	2,9 %	3,0 %
36-60	2,9 %	0,5 %
61-90	3,0 %	2,9 %
91-180	3,0 %	3,0 %
>180	3,0 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,5 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

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

Sectores	15 al 19 de Enero				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>	126	25	1037	925	58	25	645	812	22	34	743	445
<b>Real</b>	25	126	721	833	25	58	607	440	34	22	348	645
<b>Total</b>	151	151	1757	1757	83	83	1252	1252	57	57	1090	1090

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 17 de enero se presenta la proyección de vencimientos.