

Fecha de Publicación: 9 de Febrero de 2007  
 Fecha de Información: 7 de Febrero 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\$216,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	58,7	6,0	6,0	58,7	64,7
15-35	80,3	92,2	64,7	52,8	144,9
36-60	0,0	0,3	0,3	0,0	0,3
61-90	1,2	0,3	0,3	1,2	1,5
91-180	0,3	4,3	4,3	0,3	4,6
>180	0,1	0,7	0,7	0,1	0,7
<b>Total</b>	<b>140,6</b>	<b>103,8</b>	<b>76,3</b>	<b>113,1</b>	<b>216,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,7 %	-2,3 %
15-35	2,5 %	3,2 %
36-60	1,9 %	2,3 %
61-90	2,5 %	2,5 %
91-180	2,9 %	2,7 %
>180	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>1,5 %</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 8 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sectores	5 al 9 de Febrero				12 al 16 de Febrero				19 al 23 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	61	23	868	810	85	35	810	822	27	27	706	647
<b>Real</b>	23	61	631	689	35	85	676	664	27	27	475	534
<b>Total</b>	84	84	1499	1499	120	120	1486	1486	54	54	1181	1181

\* Cifras en millones de dólares