

Fecha de Publicación: 13 de Febrero de 2007  
 Fecha de Información: 09 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\$286,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	105,2	63,7	17,7	59,2	122,9
15-35	73,6	107,5	61,5	27,6	135,1
36-60	11,6	1,1	1,1	11,6	12,7
61-90	0,0	1,2	1,2	0,0	1,2
91-180	2,3	5,0	5,0	2,3	7,2
>180	0,3	7,2	7,2	0,3	7,5
<b>Total</b>	<b>193,0</b>	<b>185,7</b>	<b>93,7</b>	<b>101,0</b>	<b>286,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,0 %	2,4 %
15-35	3,3 %	2,9 %
36-60	3,1 %	3,0 %
61-90	3,4 %	3,2 %
91-180	5,1 %	4,3 %
>180	3,3 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,7 %</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 12 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	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	21	868	811	137	37	833	884	37	27	772	708
<b>Real</b>	21	61	631	689	37	137	719	667	27	37	500	564
<b>Total</b>	81	81	1499	1499	174	174	1551	1551	64	64	1272	1272

\* Cifras en millones de dólares