

Fecha de Publicación: 14 de Febrero de 2007  
 Fecha de Información: 12 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\$256,3 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	51,6	31,2	14,2	34,6	65,8
15-35	123,0	114,9	57,9	66,0	180,9
36-60	0,2	2,1	2,1	0,2	2,4
61-90	0,0	1,4	1,4	0,0	1,4
91-180	0,0	3,5	3,5	0,0	3,5
>180	0,0	2,3	2,3	0,0	2,3
<b>Total</b>	<b>174,8</b>	<b>155,5</b>	<b>81,5</b>	<b>100,8</b>	<b>256,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,1 %	6,4 %
15-35	2,3 %	1,4 %
36-60	2,6 %	2,6 %
61-90	3,0 %	2,8 %
91-180	3,0 %	2,8 %
>180	2,8 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</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 13 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	12 al 16 de Febrero				19 al 23 de Febrero				26 de Feb. al 2 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	139	37	862	902	38	27	791	720	35	34	808	608
<b>Real</b>	37	139	727	686	27	38	506	577	34	35	511	711
<b>Total</b>	176	176	1588	1588	64	64	1297	1297	69	69	1319	1319

\* Cifras en millones de dólares