

Fecha de Publicación: 15 de Febrero de 2007  
 Fecha de Información: 13 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\$380,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	60,2	66,8	46,8	40,2	106,9
15-35	145,2	70,0	39,0	114,2	184,2
36-60	42,0	5,1	5,1	42,0	47,1
61-90	10,0	6,3	6,3	10,0	16,3
91-180	14,7	4,0	4,0	14,7	18,7
>180	5,0	2,0	2,0	5,0	7,0
<b>Total</b>	<b>277,1</b>	<b>154,2</b>	<b>103,2</b>	<b>226,1</b>	<b>380,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,4 %	5,5 %
15-35	2,8 %	3,0 %
36-60	3,7 %	3,7 %
61-90	3,5 %	3,8 %
91-180	3,2 %	2,9 %
>180	3,0 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,8 %</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 14 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sectores	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	38	865	903	48	28	828	780	46	35	841	628
<b>Real</b>	38	139	728	689	28	48	545	593	35	46	515	728
<b>Total</b>	177	177	1593	1593	75	75	1373	1373	82	82	1355	1355

\* Cifras en millones de dólares