

Fecha de Publicación: 21 de Febrero de 2007  
 Fecha de Información: 19 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\$22,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,3	6,2	6,2	2,3	8,5
15-35	1,6	5,2	5,2	1,6	6,8
36-60	0,0	6,0	6,0	0,0	6,0
61-90	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
91-180	0,0	1,3	1,3	0,0	1,3
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>3,8</b>	<b>18,9</b>	<b>18,9</b>	<b>3,8</b>	<b>22,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,6 %	4,1 %
15-35	2,9 %	3,3 %
36-60	3,3 %	3,4 %
61-90	5,0 %	3,4 %
91-180	4,1 %	3,3 %
>180	3,8 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,7 %</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 20 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	19 al 23 de Febrero				26 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	49	30	871	865	48	39	859	665	38	24	474	548
<b>Real</b>	30	49	615	621	39	48	537	732	24	38	419	346
<b>Total</b>	79	79	1486	1486	87	87	1396	1396	62	62	893	893

\* Cifras en millones de dólares