

Fecha de Publicación: 22 de Enero de 2007  
 Fecha de Información: 18 de Enero 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\$332,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,9	14,9	9,9	30,9	45,7
15-35	157,4	121,0	103,0	139,4	260,4
36-60	12,6	5,1	0,1	7,6	12,8
61-90	10,1	0,6	0,6	10,1	10,6
91-180	0,0	2,9	2,9	0,0	3,0
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
<b>Total</b>	<b>216,0</b>	<b>144,6</b>	<b>116,6</b>	<b>188,0</b>	<b>332,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,8 %	2,8 %
15-35	3,1 %	2,5 %
36-60	3,1 %	2,6 %
61-90	3,0 %	2,7 %
91-180	2,9 %	3,1 %
>180	3,2 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,6 %</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 19 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sector	15 al 19 de Enero				22 al 26 de Enero				29 de Ene. al 2 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	129	26	1034	925	69	27	693	846	23	34	803	454
<b>Real</b>	26	129	721	830	27	69	623	470	34	23	351	700
<b>Total</b>	155	155	1755	1755	96	96	1316	1316	57	57	1153	1153

\* Cifras en millones de dólares