

Fecha de Publicación: 24 de Enero de 2007  
 Fecha de Información: 22 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\$414,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	81,9	24,3	10,8	68,4	92,7
15-35	187,1	157,8	95,3	124,6	282,4
36-60	12,8	0,8	0,8	12,8	13,6
61-90	1,2	0,0	0,0	1,2	1,2
91-180	20,6	0,0	0,0	20,6	20,6
>180	4,0	4,0	0,0	0,0	4,0
<b>Total</b>	<b>307,6</b>	<b>186,9</b>	<b>106,9</b>	<b>227,6</b>	<b>414,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,3 %	-3,6 %
15-35	2,3 %	1,6 %
36-60	3,0 %	2,2 %
61-90	3,3 %	3,2 %
91-180	1,6 %	2,0 %
>180	2,9 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>0,5 %</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 23 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

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

Sectores	5 al 9 de Febrero				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>	24	17	597	546	71	41	735	854	24	35	862	
<b>Real</b>	17	24	473	523	41	71	631	512	35	24	364	
<b>Total</b>	41	41	1070	1070	112	112	1366	1366	59	59	1227	1

\* Cifras en millones de dólares