

Fecha de Publicación: 5 de Febrero de 2007  
 Fecha de Información: 1 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\$318,9 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	79,8	39,3	23,3	63,8	103,1
15-35	86,7	76,1	68,1	78,7	154,8
36-60	30,7	1,6	1,6	30,7	32,4
61-90	0,3	6,3	6,3	0,3	6,6
91-180	0,0	11,7	11,7	0,0	11,7
>180	0,0	10,4	10,4	0,0	10,4
<b>Total</b>	<b>197,4</b>	<b>145,5</b>	<b>121,5</b>	<b>173,4</b>	<b>318,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

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

Sector	29 de Ene. al 2 de Febrero				5 al 9 de Febrero				12 al 16 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	42	26	944	601	24	23	790	788	33	28	793	788
<b>Real</b>	26	42	464	807	23	24	609	610	28	33	648	652
<b>Total</b>	68	68	1408	1408	47	47	1398	1398	61	61	1441	1441

\* Cifras en millones de dólares