

**Fecha de Publicación: 15 de Diciembre de 2006**  
**Fecha de Información: 13 de Diciembre de 2006 <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\$236,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,9	34,3	15,1	57,7	92,1
15-35	117,2	21,7	15,7	111,2	132,9
36-60	0,0	4,3	4,3	0,0	4,3
61-90	0,0	5,4	5,4	0,0	5,4
91-180	0,0	0,5	0,5	0,0	0,5
>180	0,5	0,9	0,9	0,5	1,4
<b>Total</b>	<b>194,7</b>	<b>67,1</b>	<b>41,9</b>	<b>169,5</b>	<b>236,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,1 %	4,4 %
15-35	3,4 %	3,5 %
36-60	3,6 %	4,2 %
61-90	3,2 %	3,0 %
91-180	4,1 %	3,7 %
>180	3,1 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,9 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

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

Sectores	11 al 15 de Diciembre				18 al 22 de Diciembre				25 al 29 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	118	30	669	635	169	27	623	734	33	23	449	441
<b>Real</b>	30	118	510	544	27	169	499	388	22	32	286	295
<b>Total</b>	148	148	1179	1179	196	196	1122	1122	55	55	736	736

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 14 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.