

**Fecha de Publicación: 18 de Diciembre de 2006**  
**Fecha de Información: 14 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\$329,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,5	32,7	32,7	19,5	52,2
15-35	64,8	70,7	57,7	51,8	122,5
36-60	8,0	60,3	60,3	8,0	68,3
61-90	0,0	8,0	8,0	0,0	8,0
91-180	0,0	4,5	4,5	0,0	4,5
>180	60,1	13,9	13,9	60,1	74,1
<b>Total</b>	<b>152,4</b>	<b>190,2</b>	<b>177,2</b>	<b>139,4</b>	<b>329,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	4,7 %
15-35	3,3 %	3,4 %
36-60	3,1 %	3,3 %
61-90	3,8 %	3,1 %
91-180	3,7 %	3,5 %
>180	3,4 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,6 %</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**

Sector	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>	121	30	667	635	168	28	640	749	33	23	453	457
<b>Real</b>	30	121	510	542	28	168	514	405	22	32	303	298
<b>Total</b>	150	150	1177	1177	196	196	1154	1154	55	55	755	755

\* 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 15 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.