

**Fecha de Publicación: 21 de Diciembre de 2006**  
**Fecha de Información: 19 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\$543,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,4	58,3	41,3	21,4	79,8
15-35	69,3	184,9	156,9	41,3	226,2
36-60	180,0	41,6	11,6	150,0	191,6
61-90	0,0	6,1	6,1	0,0	6,1
91-180	4,2	12,7	12,7	4,2	16,9
>180	4,3	18,9	18,9	4,3	23,2
<b>Total</b>	<b>296,2</b>	<b>322,6</b>	<b>247,6</b>	<b>221,2</b>	<b>543,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	3,4 %
15-35	3,4 %	3,4 %
36-60	2,6 %	3,0 %
61-90	2,7 %	3,3 %
91-180	3,3 %	3,0 %
>180	3,2 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,2 %</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	18 al 22 de Diciembre				25 al 29 de Diciembre				1 al 5 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	170	30	677	811	38	32	497	516	12	13	418	364
<b>Real</b>	30	170	549	415	31	38	353	335	13	12	256	310
<b>Total</b>	200	200	1226	1226	70	70	850	850	25	25	674	674

\* Cifras en millones de dólares

<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 20 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.