

**Fecha de Publicación: 22 de Diciembre de 2006**  
**Fecha de Información: 20 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\$488,4 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	30,8	20,1	10,1	20,8	40,9
15-35	317,5	178,9	56,9	195,5	374,4
36-60	0,0	4,0	4,0	0,0	4,0
61-90	10,3	13,9	13,9	10,3	24,2
91-180	6,6	12,7	12,7	6,6	19,3
>180	2,5	23,1	23,1	2,5	25,6
<b>Total</b>	<b>367,6</b>	<b>252,8</b>	<b>120,8</b>	<b>235,6</b>	<b>488,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

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	520	522	17	13	495	432
<b>Real</b>	30	170	549	415	32	38	359	357	13	17	271	334
<b>Total</b>	200	200	1226	1226	70	70	879	879	30	30	766	766

\* 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 21 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.