

**Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2006**  
**Fecha de Información: 26 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\$241,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,4	6,2	6,2	22,4	28,6
15-35	77,9	178,9	111,9	10,9	189,8
36-60	0,0	2,8	2,8	0,0	2,8
61-90	0,0	2,5	2,5	0,0	2,5
91-180	1,9	2,9	2,9	1,9	4,9
>180	6,0	6,5	6,5	6,0	12,5
<b>Total</b>	<b>108,2</b>	<b>199,9</b>	<b>132,9</b>	<b>41,2</b>	<b>241,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	3,2 %
15-35	3,4 %	3,1 %
36-60	4,0 %	3,3 %
61-90	3,9 %	3,4 %
91-180	3,7 %	3,1 %
>180	3,3 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,1 %</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	25 al 29 de Diciembre				8 al 12 de Enero				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>	42	33	639	579	91	19	595	539	55	13	570	492
<b>Real</b>	33	41	377	437	19	91	418	474	13	55	301	379
<b>Total</b>	74	74	1017	1017	109	109	1013	1013	68	68	871	871

\* 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 27 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.