

**Fecha de Publicación: 3 de Enero de 2007**  
**Fecha de Información: 28 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\$289,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,6	67,9	37,9	2,6	70,5
15-35	157,3	53,1	13,1	117,3	170,3
36-60	15,4	0,5	0,5	15,4	15,9
61-90	0,5	1,6	1,6	0,5	2,1
91-180	21,2	8,0	8,0	21,2	29,3
>180	1,2	0,3	0,3	1,2	1,5
<b>Total</b>	<b>228,1</b>	<b>131,5</b>	<b>61,5</b>	<b>158,1</b>	<b>289,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,7 %	-2,1 %
15-35	3,0 %	1,9 %
36-60	3,7 %	3,3 %
61-90	3,4 %	4,0 %
91-180	3,4 %	3,5 %
>180	3,1 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>2,8 %</b>	<b>1,2 %</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	25 al 29 de Diciembre				1 al 5 de Enero				8 al 12 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	41	32	639	581	56	13	595	524	147	45	654	572
<b>Real</b>	32	41	379	437	13	56	313	384	45	147	421	504
<b>Total</b>	73	73	1018	1018	69	69	908	908	191	191	1076	1076

\* 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 29 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.