

**Fecha de Publicación: 10 de Enero de 2007**  
**Fecha de Información: 05 de Enero de 2007**<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\$288,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,8	5,3	5,3	37,8	43,1
15-35	106,9	93,4	74,4	87,9	181,4
36-60	7,7	4,1	1,8	5,4	9,5
61-90	0,7	4,2	4,2	0,7	4,9
91-180	0,0	4,6	4,6	0,0	4,6
>180	44,0	1,1	1,1	44,0	45,1
<b>Total</b>	<b>197,1</b>	<b>112,8</b>	<b>91,5</b>	<b>175,8</b>	<b>288,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,7 %	1,1 %
15-35	2,3 %	2,1 %
36-60	2,6 %	2,9 %
61-90	3,3 %	2,6 %
91-180	4,0 %	3,6 %
>180	2,9 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>2,1 %</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	1 al 5 de Enero				8 al 12 de Enero				15 al 19 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	56	16	581	497	156	46	703	622	109	24	890	841
<b>Real</b>	16	56	280	364	46	156	467	548	24	109	654	703
<b>Total</b>	72	72	861	861	202	202	1170	1170	132	132	1544	1544

\* 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 8 de enero se presenta la proyección de vencimientos.