

**Fecha de Publicación: 26 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 24 de Enero 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\$249,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,5	33,3	27,3	24,5	57,7
15-35	69,9	57,0	33,9	46,8	103,8
36-60	10,9	11,8	11,8	10,9	22,7
61-90	22,6	19,9	4,7	7,4	27,3
91-180	21,6	1,2	1,2	21,6	22,8
>180	0,0	15,3	15,3	0,0	15,3
<b>Total</b>	<b>155,6</b>	<b>138,4</b>	<b>94,1</b>	<b>111,3</b>	<b>249,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	-7,6 %
15-35	0,9 %	1,5 %
36-60	0,1 %	-0,3 %
61-90	0,0 %	0,0 %
91-180	0,0 %	0,4 %
>180	1,3 %	1,1 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>-1,1 %</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	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	31	68	560	421	10	92	429	305	6	90	425	320
<b>Real</b>	67	30	211	350	92	9	170	294	90	6	160	265
<b>Total</b>	98	98	771	771	102	102	599	599	95	95	585	585

\* 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 25 de enero se presenta la proyección de vencimientos.