

**Fecha de Publicación: 2 de Febrero de 2006**  
**Fecha de Información: 31 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\$223,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,2	5,0	5,0	22,2	27,2
15-35	89,2	84,7	68,2	72,7	157,4
36-60	12,1	5,1	0,1	7,1	12,2
61-90	0,4	3,0	3,0	0,4	3,4
91-180	10,9	21,3	11,3	0,9	22,2
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
<b>Total</b>	<b>134,9</b>	<b>120,3</b>	<b>88,8</b>	<b>103,4</b>	<b>223,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-8,0 %	-9,0 %
15-35	-0,9 %	-0,9 %
36-60	-0,1 %	-0,3 %
61-90	-0,2 %	-0,1 %
91-180	0,5 %	0,3 %
>180	1,3 %	1,4 %
<b>Total</b>	<b>-1,1 %</b>	<b>-1,7 %</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**

Sector	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	26	97	497	347	7	92	491	357	11	121	416	364
<b>Real</b>	97	26	200	349	92	7	163	297	121	11	193	246
<b>Total</b>	123	123	697	697	99	99	653	653	132	132	609	609

\* 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 1 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.