

**Fecha de Publicación: 6 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 04 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\$123,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,7	8,0	0,0	13,7	21,7
15-35	13,6	42,9	36,9	7,6	50,5
36-60	27,7	29,2	3,2	1,7	30,9
61-90	12,5	0,0	0,0	12,5	12,5
91-180	6,7	0,7	0,7	6,7	7,4
>180	0,0	0,5	0,5	0,0	0,5
<b>Total</b>	<b>82,1</b>	<b>81,3</b>	<b>41,3</b>	<b>42,1</b>	<b>123,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,3 %	0,2 %
15-35	0,7 %	0,6 %
36-60	1,3 %	1,2 %
61-90	0,6 %	0,5 %
91-180	1,1 %	0,6 %
>180	2,1 %	2,2 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>0,7 %</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**

Sectores	9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	13	53	539	338	3	48	501	408	4	47	457	372
<b>Real</b>	53	13	132	332	48	3	252	344	47	4	178	263
<b>Total</b>	66	66	671	671	50	50	753	753	50	50	635	635

\* 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 5 de enero se presenta la proyección de vencimientos.