

**Fecha de Publicación: 11 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 06 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\$88,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,6	1,2	1,2	6,6	7,8
15-35	16,4	43,2	33,2	6,4	49,6
36-60	0,3	2,1	2,1	0,3	2,4
61-90	4,0	0,6	0,6	4,0	4,6
91-180	3,2	15,3	15,3	3,2	18,5
>180	5,0	0,2	0,2	5,0	5,2
<b>Total</b>	<b>35,5</b>	<b>62,6</b>	<b>52,6</b>	<b>25,5</b>	<b>88,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,8 %	2,1 %
15-35	0,2 %	0,1 %
36-60	0,3 %	0,6 %
61-90	0,3 %	0,3 %
91-180	1,0 %	0,8 %
>180	1,3 %	1,1 %
<b>Total</b>	<b>1,8 %</b>	<b>0,5 %</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>	15	55	541	346	3	48	536	437	4	47	457	372
<b>Real</b>	54	15	139	334	48	3	253	353	47	4	178	263
<b>Total</b>	69	69	680	680	51	51	789	789	50	50	635	635

\* 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 9 de enero se presenta la proyección de vencimientos.