

**Fecha de Publicación: 13 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 11 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\$294,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,0	33,3	0,0	0,7	34,0
15-35	41,9	82,8	48,3	7,4	90,3
36-60	42,0	16,6	6,6	32,0	48,6
61-90	54,3	3,5	0,2	51,0	54,5
91-180	35,2	30,6	0,6	5,2	35,7
>180	28,1	21,1	3,1	10,1	31,2
<b>Total</b>	<b>235,6</b>	<b>187,8</b>	<b>58,7</b>	<b>106,5</b>	<b>294,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,1 %	1,4 %
15-35	0,2 %	0,4 %
36-60	0,6 %	0,4 %
61-90	0,6 %	0,3 %
91-180	0,8 %	0,6 %
>180	1,3 %	1,7 %
<b>Total</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,6 %</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	9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero				23 al 27 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	600	405	4	48	609	502	5	63	353	235
<b>Real</b>	54	15	139	334	48	4	253	360	62	5	139	257
<b>Total</b>	69	69	739	739	52	52	862	862	68	68	492	492

\* 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 12 de enero se presenta la proyección de vencimientos.