

**Fecha de Publicación: 20 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 18 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\$266,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,3	81,5	50,5	7,3	88,8
15-35	80,7	92,3	46,3	34,7	127,0
36-60	6,5	1,4	1,4	6,5	7,9
61-90	26,1	21,5	6,5	11,1	32,5
91-180	8,4	7,1	2,1	3,4	10,5
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>159,9</b>	<b>203,9</b>	<b>106,9</b>	<b>62,9</b>	<b>266,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,5 %	0,3 %
15-35	-0,1 %	-0,1 %
36-60	-0,1 %	0,0 %
61-90	0,4 %	0,3 %
91-180	1,0 %	0,4 %
>180	1,8 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>0,3 %</b>	<b>0,1 %</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	16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	14	47	629	579	15	68	493	373	6	54	353	253
<b>Real</b>	47	14	323	373	67	14	207	327	54	6	150	250
<b>Total</b>	60	60	952	952	82	82	700	700	59	59	503	503

\* 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 19 de enero se presenta la proyección de vencimientos.