

**Fecha de Publicación: 24 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 20 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\$214,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,5	30,1	0,1	23,5	53,6
15-35	60,4	33,7	23,7	50,4	84,1
36-60	1,6	45,7	45,7	1,6	47,2
61-90	12,0	6,1	1,1	7,0	13,1
91-180	0,4	2,3	2,3	0,4	2,6
>180	13,5	0,4	0,4	13,5	13,9
<b>Total</b>	<b>141,3</b>	<b>118,2</b>	<b>73,2</b>	<b>96,3</b>	<b>214,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,7 %	-0,7 %
15-35	0,0 %	0,1 %
36-60	0,5 %	0,4 %
61-90	0,5 %	0,2 %
91-180	0,6 %	0,7 %
>180	1,2 %	0,9 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>0,0 %</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	31	68	532	393	8	72	381	270
<b>Real</b>	47	14	323	373	67	30	207	346	72	7	157	268
<b>Total</b>	60	60	952	952	98	98	739	739	80	80	538	538

\* 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 23 de enero se presenta la proyección de vencimientos.