

**Fecha de Publicación: 25 de Enero de 2006**  
**Fecha de Información: 23 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\$422,6 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	58,6	46,3	3,3	15,6	61,8
15-35	159,3	116,2	79,2	122,3	238,5
36-60	60,3	13,4	8,4	55,3	68,7
61-90	0,0	10,1	10,1	0,0	10,1
91-180	33,9	2,8	2,8	33,9	36,7
>180	0,0	6,9	6,9	0,0	6,9
<b>Total</b>	<b>312,1</b>	<b>195,6</b>	<b>110,6</b>	<b>227,1</b>	<b>422,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

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

Sectores	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	31	68	560	421	8	72	411	294	6	90	409	295
<b>Real</b>	67	30	211	350	72	8	162	280	90	6	137	251
<b>Total</b>	98	98	771	771	80	80	574	574	95	95	546	546

\* 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 24 de enero se presenta la proyección de vencimientos.