

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2007  
 Fecha de Información: 13 de Julio de 2007 <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\$553,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,2%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero |              | Sector Real  |              | Total        |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|              | Compras           | Ventas       | Compras      | Ventas       |              |
| 3-14         | 174,2             | 108,3        | 68,3         | 134,2        | 242,5        |
| 15-35        | 73,8              | 198,1        | 184,1        | 59,8         | 257,8        |
| 36-60        | 14,0              | 3,9          | 3,9          | 14,0         | 18,0         |
| 61-90        | 15,0              | 5,7          | 5,7          | 15,0         | 20,7         |
| 91-180       | 2,1               | 7,7          | 7,7          | 2,1          | 9,8          |
| >180         | 0,0               | 5,0          | 5,0          | 0,0          | 5,0          |
| <b>Total</b> | <b>279,2</b>      | <b>328,7</b> | <b>274,7</b> | <b>225,2</b> | <b>553,8</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14         | 1,6 %           | -5,1 %                       |
| 15-35        | 3,5 %           | 3,8 %                        |
| 36-60        | 3,9 %           | 3,6 %                        |
| 61-90        | 3,7 %           | 2,0 %                        |
| 91-180       | 3,8 %           | 3,7 %                        |
| >180         | 4,4 %           | 4,4 %                        |
| <b>Total</b> | <b>3,2 %</b>    | <b>-0,2 %</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 Julio |           |             |             | 16 al 20 de Julio |           |             |             | 23 al 27 de Julio |           |             |             |
|--------------|------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|
|              | Delivery         |           | NDF         |             | Delivery          |           | NDF         |             | Delivery          |           | NDF         |             |
|              | C                | V         | C           | V           | C                 | V         | C           | V           | C                 | V         | C           | V           |
| Financiero   | 15               | 23        | 989         | 925         | 12                | 20        | 928         | 840         | 7                 | 27        | 932         | 861         |
| Real         | 23               | 15        | 894         | 958         | 20                | 12        | 733         | 821         | 27                | 7         | 748         | 818         |
| <b>Total</b> | <b>37</b>        | <b>37</b> | <b>1883</b> | <b>1883</b> | <b>33</b>         | <b>33</b> | <b>1661</b> | <b>1661</b> | <b>34</b>         | <b>34</b> | <b>1680</b> | <b>1680</b> |

\* 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 13 de julio se presenta la proyección de vencimientos.