

Fecha de Publicación: 17 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\$272,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	58,5	36,0	36,0	58,5	94,5
15-35	82,2	91,5	72,9	63,7	155,1
36-60	0,8	7,3	7,3	0,8	8,1
61-90	0,0	5,7	5,7	0,0	5,7
91-180	0,2	4,1	4,1	0,2	4,3
>180	0,1	5,1	5,1	0,1	5,2
<b>Total</b>	<b>141,7</b>	<b>149,7</b>	<b>131,2</b>	<b>123,2</b>	<b>272,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,9 %	2,7 %
15-35	3,0 %	2,9 %
36-60	4,1 %	4,0 %
61-90	4,3 %	3,6 %
91-180	3,8 %	3,9 %
>180	3,4 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>2,9 %</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	14	22	989	925	13	20	952	860	7	27	966	877
Real	22	14	894	958	20	13	753	845	27	7	764	853
<b>Total</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>1884</b>	<b>1884</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>1705</b>	<b>1705</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>1730</b>	<b>1730</b>

\* 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 16 de julio se presenta la proyección de vencimientos.