

Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2007  
 Fecha de Información: 24 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\$743,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	132,3	11,5	11,5	132,3	143,8
15-35	271,5	293,4	253,4	231,5	525,0
36-60	29,5	35,6	35,6	29,5	65,1
61-90	4,3	0,1	0,1	4,3	4,3
91-180	1,0	0,1	0,1	1,0	1,1
>180	1,4	2,5	2,5	1,4	3,9
<b>Total</b>	<b>440,0</b>	<b>343,2</b>	<b>303,2</b>	<b>400,0</b>	<b>743,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,4 %	4,4 %
15-35	6,1 %	6,5 %
36-60	4,0 %	4,2 %
61-90	3,8 %	4,4 %
91-180	3,2 %	2,5 %
>180	3,4 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,9 %</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	23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	4	23	1614	1558	9	70	734	644	4	25	676	633
Real	23	4	1405	1461	70	9	587	677	25	4	570	614
<b>Total</b>	<b>27</b>	<b>27</b>	<b>3019</b>	<b>3019</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>1321</b>	<b>1321</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>1246</b>	<b>1246</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 25 de julio se presenta la proyección de vencimientos.