

Fecha de Publicación: 1 de Agosto de 2007

Fecha de Información: 30 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\$330,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero |              | Sector Real  |              | Total        |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|              | Compras           | Ventas       | Compras      | Ventas       |              |
| 3-14         | 37,0              | 46,1         | 46,1         | 37,0         | 83,2         |
| 15-35        | 65,2              | 97,0         | 91,0         | 59,2         | 156,3        |
| 36-60        | 14,2              | 28,7         | 28,7         | 14,2         | 42,9         |
| 61-90        | 0,0               | 0,6          | 0,6          | 0,0          | 0,6          |
| 91-180       | 23,9              | 13,7         | 7,7          | 17,9         | 31,6         |
| >180         | 9,0               | 6,6          | 6,6          | 9,0          | 15,6         |
| <b>Total</b> | <b>149,4</b>      | <b>192,7</b> | <b>180,7</b> | <b>137,4</b> | <b>330,1</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14         | 3,7 %           | 2,8 %                        |
| 15-35        | 3,9 %           | 3,9 %                        |
| 36-60        | 3,3 %           | 3,7 %                        |
| 61-90        | 4,7 %           | 4,6 %                        |
| 91-180       | 3,6 %           | 3,7 %                        |
| >180         | 3,8 %           | 3,7 %                        |
| <b>Total</b> | <b>3,8 %</b>    | <b>3,6 %</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     | 30 de Jul. al 3 de Agosto |           |             |             | 6 al 10 de Agosto |           |             |             | 13 al 17 de Agosto |           |             |             |
|--------------|---------------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|--------------------|-----------|-------------|-------------|
|              | Delivery                  |           | NDF         |             | Delivery          |           | NDF         |             | Delivery           |           | NDF         |             |
|              | C                         | V         | C           | V           | C                 | V         | C           | V           | C                  | V         | C           | V           |
| Financiero   | 14                        | 59        | 886         | 761         | 8                 | 25        | 802         | 719         | 8                  | 35        | 668         | 655         |
| Real         | 59                        | 14        | 704         | 829         | 25                | 8         | 645         | 727         | 35                 | 8         | 615         | 628         |
| <b>Total</b> | <b>73</b>                 | <b>73</b> | <b>1590</b> | <b>1590</b> | <b>33</b>         | <b>33</b> | <b>1447</b> | <b>1447</b> | <b>43</b>          | <b>43</b> | <b>1283</b> | <b>1283</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 31 de julio se presenta la proyección de vencimientos.