

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 01 de Agosto 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\$410,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,1	48,4	48,4	13,1	61,4
15-35	121,8	179,0	179,0	121,8	300,8
36-60	13,3	0,0	0,0	13,3	13,3
61-90	0,3	13,3	13,3	0,3	13,6
91-180	17,0	4,1	4,1	17,0	21,0
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
<b>Total</b>	<b>165,4</b>	<b>244,8</b>	<b>244,8</b>	<b>165,4</b>	<b>410,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,4 %	3,6 %
15-35	3,1 %	3,3 %
36-60	1,8 %	3,1 %
61-90	3,6 %	4,5 %
91-180	3,4 %	3,3 %
>180	4,5 %	4,5 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>3,4 %</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**

Sector	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	8	56	885	778	9	25	835	803	8	35	721	726
Real	56	8	721	828	25	9	714	745	35	8	660	655
<b>Total</b>	<b>63</b>	<b>63</b>	<b>1606</b>	<b>1606</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>1548</b>	<b>1548</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>1381</b>	<b>1381</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 2 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.