

Fecha de Publicación: 6 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 02 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\$453,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero |              | Sector Real  |              | Total        |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|              | Compras           | Ventas       | Compras      | Ventas       |              |
| 3-14         | 53,0              | 112,7        | 97,7         | 38,0         | 150,6        |
| 15-35        | 137,4             | 121,2        | 115,4        | 131,7        | 252,9        |
| 36-60        | 45,1              | 15,1         | 0,1          | 30,1         | 45,2         |
| 61-90        | 0,0               | 2,7          | 2,7          | 0,0          | 2,7          |
| 91-180       | 0,4               | 0,7          | 0,7          | 0,4          | 1,1          |
| >180         | 0,0               | 0,9          | 0,9          | 0,0          | 0,9          |
| <b>Total</b> | <b>236,0</b>      | <b>253,3</b> | <b>217,5</b> | <b>200,2</b> | <b>453,5</b> |

\* Cifras en millones de dólares

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

| Rango        | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14         | 2,7 %           | 1,5 %                        |
| 15-35        | 2,8 %           | 3,0 %                        |
| 36-60        | 2,5 %           | 2,6 %                        |
| 61-90        | 3,8 %           | 3,9 %                        |
| 91-180       | 4,0 %           | 3,6 %                        |
| >180         | 4,2 %           | 4,7 %                        |
| <b>Total</b> | <b>3,0 %</b>    | <b>2,4 %</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**

| 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   | 7                         | 23        | 885         | 811         | 9                 | 26        | 847         | 840         | 8                  | 35        | 762         | 806         |
| Real         | 23                        | 7         | 754         | 828         | 26                | 9         | 751         | 757         | 35                 | 8         | 726         | 681         |
| <b>Total</b> | <b>30</b>                 | <b>30</b> | <b>1639</b> | <b>1639</b> | <b>35</b>         | <b>35</b> | <b>1598</b> | <b>1598</b> | <b>43</b>          | <b>43</b> | <b>1488</b> | <b>1488</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 3 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.