

Fecha de Publicación: 16 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 14 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\$487,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,0	58,5	48,5	62,0	120,5
15-35	102,3	209,6	191,1	83,8	293,3
36-60	6,7	0,4	0,4	6,7	7,2
61-90	4,9	1,3	1,3	4,9	6,3
91-180	19,6	9,6	9,6	19,6	29,2
>180	7,4	23,1	23,1	7,4	30,5
<b>Total</b>	<b>213,0</b>	<b>302,5</b>	<b>274,0</b>	<b>184,5</b>	<b>487,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,0 %	7,2 %
15-35	6,2 %	7,9 %
36-60	4,4 %	4,9 %
61-90	4,9 %	4,9 %
91-180	4,1 %	4,4 %
>180	4,0 %	4,7 %
<b>Total</b>	<b>5,3 %</b>	<b>7,2 %</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	13 al 17 de Agosto				20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	41	1098	1056	65	15	1225	1277	7	19	848	1209
Real	41	18	951	992	15	65	1137	1085	19	7	1146	785
<b>Total</b>	<b>59</b>	<b>59</b>	<b>2048</b>	<b>2048</b>	<b>80</b>	<b>80</b>	<b>2362</b>	<b>2362</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>1994</b>	<b>1994</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 15 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.