

Fecha de Publicación: 17 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 15 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\$746,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	111,5	88,4	84,4	107,5	195,8
15-35	230,8	209,9	187,9	208,8	418,6
36-60	19,9	2,0	2,0	19,9	21,9
61-90	22,9	2,1	2,1	22,9	25,0
91-180	11,7	32,2	22,2	1,7	33,9
>180	1,1	50,0	50,0	1,1	51,1
<b>Total</b>	<b>397,8</b>	<b>384,5</b>	<b>348,5</b>	<b>361,8</b>	<b>746,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	10,6 %
15-35	4,8 %	4,9 %
36-60	4,7 %	4,4 %
61-90	4,8 %	2,8 %
91-180	4,4 %	4,0 %
>180	4,0 %	5,1 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>6,3 %</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	19	30	1098	1088	23	15	1360	1349	10	19	885	1228
Real	30	19	982	992	15	23	1205	1216	19	10	1166	822
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>2080</b>	<b>2080</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>2565</b>	<b>2565</b>	<b>29</b>	<b>29</b>	<b>2050</b>	<b>2050</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 16 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.