

Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 22 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\$335,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,6	42,1	42,1	68,6	110,7
15-35	121,7	58,7	58,7	121,7	180,4
36-60	15,3	0,2	0,2	15,3	15,5
61-90	12,5	12,2	12,2	12,5	24,7
91-180	2,8	0,3	0,3	2,8	3,1
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
<b>Total</b>	<b>220,9</b>	<b>114,6</b>	<b>114,6</b>	<b>220,9</b>	<b>335,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,2 %	-3,7 %
15-35	6,9 %	3,0 %
36-60	5,3 %	1,3 %
61-90	6,4 %	4,9 %
91-180	5,8 %	5,2 %
>180	5,4 %	4,7 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>0,9 %</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	20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	12	1502	1482	15	19	1039	1306	16	36	610	903
Real	12	22	1334	1354	19	15	1244	976	36	16	857	564
<b>Total</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>2836</b>	<b>2836</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>2282</b>	<b>2282</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>1467</b>	<b>1467</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 23 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.