

Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 29 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\$330,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,1	93,4	90,4	63,1	156,5
15-35	71,1	66,0	64,0	69,1	135,1
36-60	2,2	0,0	0,0	2,2	2,3
61-90	4,9	1,1	1,1	4,9	6,0
91-180	8,1	16,4	16,4	8,1	24,5
>180	5,6	0,0	0,0	5,6	5,6
<b>Total</b>	<b>158,0</b>	<b>177,0</b>	<b>172,0</b>	<b>153,0</b>	<b>330,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,3 %	7,0 %
15-35	7,7 %	7,4 %
36-60	5,9 %	5,5 %
61-90	5,3 %	5,2 %
91-180	5,4 %	5,1 %
>180	4,2 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>6,3 %</b>	<b>6,9 %</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	3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre				27 al 31 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	17	35	719	1043	24	28	737	961	16	19	1251	1471
Real	35	17	988	664	28	24	859	635	19	16	1408	1188
<b>Total</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>1707</b>	<b>1707</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>1596</b>	<b>1596</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>2659</b>	<b>2659</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 30 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.