

Fecha de Publicación: 3 de Septiembre de 2007

Fecha de Información: 30 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\$424,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,4	82,5	82,5	49,4	131,9
15-35	118,0	117,1	109,6	110,5	227,6
36-60	7,8	6,4	6,4	7,8	14,1
61-90	2,8	4,3	4,3	2,8	7,1
91-180	20,4	18,5	18,5	20,4	38,9
>180	0,5	4,1	4,1	0,5	4,6
<b>Total</b>	<b>198,9</b>	<b>232,9</b>	<b>225,4</b>	<b>191,4</b>	<b>424,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	5,1 %
15-35	6,7 %	7,3 %
36-60	4,2 %	4,3 %
61-90	5,4 %	5,3 %
91-180	4,1 %	4,1 %
>180	4,2 %	4,8 %
<b>Total</b>	<b>5,1 %</b>	<b>6,2 %</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	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	36	743	1095	25	28	764	1011	17	19	1251	1471
Real	36	17	1040	688	28	25	908	662	19	17	1408	1188
<b>Total</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>1783</b>	<b>1783</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>1673</b>	<b>1673</b>	<b>36</b>	<b>36</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 31 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.