

Fecha de Publicación: 22 de Agosto de 2007  
 Fecha de Información: 17 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\$513,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	78,5	50,8	46,3	74,0	124,8
15-35	174,4	118,0	117,0	173,4	291,4
36-60	33,9	1,1	1,1	33,9	35,0
61-90	6,6	7,6	7,6	6,6	14,2
91-180	39,6	4,3	4,3	39,6	43,9
>180	2,6	1,4	1,4	2,6	4,1
<b>Total</b>	<b>335,6</b>	<b>183,3</b>	<b>177,8</b>	<b>330,1</b>	<b>513,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,1 %	12,1 %
15-35	3,8 %	2,3 %
36-60	3,5 %	5,9 %
61-90	3,3 %	2,4 %
91-180	3,5 %	3,1 %
>180	4,5 %	5,1 %
<b>Total</b>	<b>4,5 %</b>	<b>5,1 %</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	20	30	1098	1089	24	16	1468	1448	10	19	966	1264
Real	30	20	984	992	16	24	1300	1320	19	10	1201	904
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>2082</b>	<b>2082</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>2769</b>	<b>2769</b>	<b>29</b>	<b>29</b>	<b>2167</b>	<b>2167</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 20 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.