

Fecha de Publicación: 13 de Junio de 2007  
 Fecha de Información: 8 de Junio 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\$561,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	115,9	68,1	61,1	108,9	177,0
15-35	167,8	54,2	54,2	167,8	222,0
36-60	9,0	10,8	3,8	2,0	12,8
61-90	28,9	104,8	104,8	28,9	133,7
91-180	8,3	4,7	4,7	8,3	13,0
>180	1,7	1,0	1,0	1,7	2,7
<b>Total</b>	<b>331,6</b>	<b>243,6</b>	<b>229,6</b>	<b>317,6</b>	<b>561,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,3 %	-0,4 %
15-35	-0,1 %	-1,0 %
36-60	1,1 %	-0,8 %
61-90	1,9 %	4,2 %
91-180	1,7 %	2,3 %
>180	2,0 %	2,5 %
<b>Total</b>	<b>0,6 %</b>	<b>0,6 %</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	4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	51	37	965	1036	130	50	764	789	12	31	616	603
Real	37	51	893	822	50	130	718	692	31	12	541	555
<b>Total</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>1857</b>	<b>1857</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>1482</b>	<b>1482</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>1158</b>	<b>1158</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 11 de junio se presenta la proyección de vencimientos.