

**Fecha de Publicación: 5 de Septiembre de 2007**  
**Fecha de Información: 03 de Septiembre 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\$27,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,7	0,2	0,2	1,7	2,0
15-35	19,4	3,8	3,8	19,4	23,1
36-60	1,0	0,2	0,2	1,0	1,2
61-90	0,0	0,7	0,7	0,0	0,7
91-180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>22,1</b>	<b>5,0</b>	<b>5,0</b>	<b>22,1</b>	<b>27,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	0,3 %
15-35	3,9 %	5,4 %
36-60	5,2 %	4,3 %
61-90	6,0 %	6,2 %
91-180	5,2 %	5,3 %
>180	-	-
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>5,0 %</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				17 al 21 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	19	47	759	1095	26	28	776	1086	20	47	870	970
<b>Real</b>	47	19	1040	704	28	26	984	673	47	20	874	774
<b>Total</b>	66	66	1799	1799	54	54	1760	1760	66	66	1744	1744

\* 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 4 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.