

**Fecha de Publicación: 10 de Septiembre de 2007**  
**Fecha de Información: 06 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\$737,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	133,5	107,7	102,7	128,5	236,2
15-35	58,9	298,8	298,8	58,9	357,7
36-60	5,9	5,2	0,2	0,9	6,1
61-90	33,6	3,3	3,3	33,6	36,9
91-180	30,4	44,8	44,8	30,4	75,3
>180	0,0	25,0	25,0	0,0	25,0
<b>Total</b>	<b>262,3</b>	<b>484,8</b>	<b>474,8</b>	<b>252,3</b>	<b>737,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,1 %	10,0 %
15-35	5,3 %	6,3 %
36-60	5,3 %	3,1 %
61-90	4,9 %	4,0 %
91-180	4,7 %	4,8 %
>180	4,5 %	6,2 %
<b>Total</b>	<b>5,5 %</b>	<b>7,2 %</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				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>	18	45	784	1119	26	29	1021	1194	21	47	955	1113
<b>Real</b>	45	18	1057	722	29	26	1097	924	47	21	984	826
<b>Total</b>	64	64	1841	1841	55	55	2118	2118	68	68	1939	1939

\* 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 7 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.