

**Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2007**  
**Fecha de Información: 10 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\$465,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,0	15,0	15,0	64,0	79,0
15-35	134,8	139,2	138,2	133,8	273,0
36-60	30,4	38,5	38,5	30,4	68,8
61-90	2,2	0,3	0,3	2,2	2,6
91-180	7,2	33,5	31,3	5,0	38,5
>180	2,7	1,0	1,0	2,7	3,8
<b>Total</b>	<b>241,3</b>	<b>227,6</b>	<b>224,4</b>	<b>238,1</b>	<b>465,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	-5,4 %
15-35	4,4 %	2,8 %
36-60	4,5 %	4,1 %
61-90	4,7 %	4,2 %
91-180	4,5 %	3,1 %
>180	4,0 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>1,6 %</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	10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	30	29	1226	1286	20	51	1011	1118	13	34	968	937
<b>Real</b>	29	30	1163	1104	51	20	989	882	34	13	795	826
<b>Total</b>	59	59	2390	2390	71	71	2000	2000	47	47	1763	1763

\* 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 septiembre se presenta la proyección de vencimientos.