

**Fecha de Publicación: 11 de Septiembre de 2007**  
**Fecha de Información: 07 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\$569,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	198,5	85,6	60,6	173,5	259,1
15-35	94,0	190,6	157,6	61,0	251,6
36-60	1,9	13,2	13,2	1,9	15,0
61-90	3,0	23,8	23,8	3,0	26,8
91-180	4,2	0,1	0,1	4,2	4,3
>180	10,8	2,0	2,0	10,8	12,8
<b>Total</b>	<b>312,4</b>	<b>315,2</b>	<b>257,2</b>	<b>254,4</b>	<b>569,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	11,3 %
15-35	4,9 %	5,7 %
36-60	3,9 %	5,7 %
61-90	3,7 %	4,9 %
91-180	3,5 %	3,9 %
>180	3,4 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>8,2 %</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	28	29	1211	1275	21	47	964	1118
<b>Real</b>	45	18	1057	722	29	28	1152	1088	47	21	989	835
<b>Total</b>	64	64	1841	1841	57	57	2363	2363	68	68	1952	1952

\* 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 10 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.