

**Fecha de Publicación: 19 de Septiembre de 2007**  
**Fecha de Información: 17 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\$525,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	107,6	53,1	40,1	94,6	147,7
15-35	172,6	134,5	124,5	162,6	297,1
36-60	14,0	13,7	3,7	4,0	17,7
61-90	1,3	0,5	0,5	1,3	1,9
91-180	14,1	45,3	35,3	4,1	49,4
>180	1,1	10,5	10,5	1,1	11,6
<b>Total</b>	<b>310,8</b>	<b>257,6</b>	<b>214,6</b>	<b>267,8</b>	<b>525,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,1 %	0,4 %
15-35	3,3 %	2,1 %
36-60	4,4 %	5,4 %
61-90	4,9 %	4,4 %
91-180	3,6 %	4,0 %
>180	3,8 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,0 %</b>	<b>1,9 %</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	17 al 21 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				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>	22	46	1215	1354	9	17	544	801	11	36	1098	1034
<b>Real</b>	46	22	1209	1071	17	9	767	511	36	11	889	953
<b>Total</b>	67	67	2424	2424	26	26	1312	1312	47	47	1987	1987

\* 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 18 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.