

**Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2007**  
**Fecha de Información: 25 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\$781,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	46,1	118,1	118,1	46,1	164,2
15-35	145,4	383,4	380,2	142,2	525,6
36-60	17,2	21,2	21,2	17,2	38,4
61-90	15,1	1,6	1,6	15,1	16,7
91-180	1,5	3,2	3,2	1,5	4,8
>180	26,1	5,6	5,6	26,1	31,7
<b>Total</b>	<b>251,5</b>	<b>533,1</b>	<b>529,9</b>	<b>248,3</b>	<b>781,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,4 %	9,8 %
15-35	2,2 %	0,7 %
36-60	1,7 %	0,8 %
61-90	3,3 %	1,1 %
91-180	2,8 %	2,9 %
>180	3,4 %	2,7 %
<b>Total</b>	<b>4,5 %</b>	<b>2,7 %</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	24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	12	33	1382	1282	8	19	748	999	8	44	812	1079
<b>Real</b>	33	12	1125	1225	19	8	959	708	44	8	1006	738
<b>Total</b>	45	45	2507	2507	27	27	1707	1707	52	52	1817	1817

\* 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 26 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.