

Fecha de Publicación: 4 de Octubre de 2007  
 Fecha de Información: 02 de Octubre 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\$328,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,6	49,7	49,7	32,6	82,2
15-35	78,1	166,9	155,9	67,1	234,0
36-60	1,9	0,0	0,0	1,9	1,9
61-90	4,0	0,5	0,5	4,0	4,4
91-180	0,3	0,7	0,6	0,3	1,0
>180	4,9	0,1	0,1	4,9	5,0
<b>Total</b>	<b>121,8</b>	<b>217,8</b>	<b>206,8</b>	<b>110,7</b>	<b>328,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	5,7 %
15-35	2,9 %	2,9 %
36-60	3,9 %	3,6 %
61-90	3,1 %	3,2 %
91-180	3,8 %	3,6 %
>180	3,5 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,7 %</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	1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	20	922	1131	9	44	979	1186	19	25	818	802
Real	20	16	1101	891	44	9	1104	897	25	19	772	788
<b>Total</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>2022</b>	<b>2022</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>2083</b>	<b>2083</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>1590</b>	<b>1590</b>

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 3 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.