

**Fecha de Publicación: 5 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 03 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\$525,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,8	66,1	56,1	103,8	169,8
15-35	133,3	181,0	155,8	108,1	289,2
36-60	12,6	22,3	22,3	12,6	34,9
61-90	5,8	1,4	1,4	5,8	7,2
91-180	0,9	10,1	10,1	0,9	11,0
>180	12,9	0,0	0,0	12,9	12,9
<b>Total</b>	<b>279,3</b>	<b>280,9</b>	<b>245,7</b>	<b>244,1</b>	<b>525,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,2 %	0,9 %
15-35	2,8 %	3,1 %
36-60	4,3 %	5,3 %
61-90	4,1 %	3,0 %
91-180	4,2 %	4,3 %
>180	3,0 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,6 %</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	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
<b>Financiero</b>	16	20	922	1131	10	44	1075	1241	19	26	851	829
<b>Real</b>	20	16	1101	891	44	10	1149	983	26	19	790	812
<b>Total</b>	36	36	2022	2022	54	54	2224	2224	45	45	1641	1641

\* 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 4 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.