

**Fecha de Publicación: 9 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 05 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\$640,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	115,9	80,0	80,0	115,9	195,9
15-35	194,7	138,0	134,0	190,7	328,7
36-60	18,0	8,8	8,8	18,0	26,8
61-90	35,7	6,1	6,1	35,7	41,7
91-180	10,3	21,3	21,0	10,0	31,3
>180	4,6	11,4	11,4	4,6	16,0
<b>Total</b>	<b>379,1</b>	<b>265,6</b>	<b>261,3</b>	<b>374,9</b>	<b>640,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,0 %	-3,9 %
15-35	2,6 %	3,0 %
36-60	2,9 %	3,8 %
61-90	3,8 %	3,1 %
91-180	3,7 %	3,4 %
>180	4,3 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>1,0 %</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	19	922	1133	10	42	1254	1329	20	24	880	902
<b>Real</b>	19	16	1103	892	42	10	1218	1143	24	20	863	840
<b>Total</b>	35	35	2025	2025	53	53	2472	2472	43	43	1742	1742

\* 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 8 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.