

Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2007  
 Fecha de Información: 11 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\$433,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,1	26,9	26,9	26,1	53,1
15-35	68,0	223,0	217,0	62,0	285,0
36-60	72,7	0,7	0,7	72,7	73,4
61-90	3,8	2,6	2,6	3,8	6,3
91-180	4,5	5,2	5,2	4,5	9,7
>180	0,9	4,7	4,7	0,9	5,6
<b>Total</b>	<b>175,9</b>	<b>263,2</b>	<b>257,2</b>	<b>169,9</b>	<b>433,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,7 %	4,6 %
15-35	3,8 %	3,4 %
36-60	3,7 %	3,0 %
61-90	4,2 %	3,5 %
91-180	4,4 %	3,6 %
>180	5,2 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>3,5 %</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	8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	8	34	1262	1352	20	24	954	951	9	32	741	811
Real	34	8	1241	1151	24	20	904	907	32	9	748	678
<b>Total</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>2503</b>	<b>2503</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>1858</b>	<b>1858</b>	<b>41</b>	<b>41</b>	<b>1488</b>	<b>1488</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 12 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.