

**Fecha de Publicación: 18 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 16 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\$457,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,9	42,9	42,9	72,9	115,8
15-35	117,6	169,8	169,8	117,6	287,4
36-60	5,8	4,6	4,6	5,8	10,4
61-90	12,8	1,5	1,5	12,8	14,4
91-180	16,2	0,1	0,1	16,2	16,2
>180	2,8	10,3	10,3	2,8	13,1
<b>Total</b>	<b>228,1</b>	<b>229,2</b>	<b>229,2</b>	<b>228,1</b>	<b>457,3</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,4 %	4,1 %
15-35	2,7 %	5,2 %
36-60	2,2 %	4,6 %
61-90	2,7 %	3,0 %
91-180	3,3 %	3,0 %
>180	4,4 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,7 %</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	15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre				29 de Oct. al 2 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	19	23	992	997	11	32	795	847	7	29	853	1108
<b>Real</b>	23	19	950	945	32	11	784	732	29	7	1010	755
<b>Total</b>	42	42	1942	1942	43	43	1579	1579	36	36	1864	1864

\* 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 17 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.