

**Fecha de Publicación: 22 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 18 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\$565,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	158,4	104,9	74,9	128,4	233,3
15-35	56,8	212,6	207,6	51,8	264,5
36-60	0,9	22,2	22,2	0,9	23,1
61-90	20,2	15,1	15,1	20,2	35,3
91-180	4,7	2,7	2,7	4,7	7,4
>180	1,4	0,6	0,6	1,4	2,0
<b>Total</b>	<b>242,4</b>	<b>358,1</b>	<b>323,1</b>	<b>207,4</b>	<b>565,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,3 %	3,0 %
15-35	3,9 %	4,7 %
36-60	3,7 %	7,0 %
61-90	1,9 %	1,2 %
91-180	3,5 %	3,1 %
>180	3,6 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>5,3 %</b>	<b>3,9 %</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	19	990	1001	12	26	923	1007	14	30	971	1165
<b>Real</b>	19	19	954	943	26	12	902	818	30	14	1067	873
<b>Total</b>	38	38	1944	1944	38	38	1825	1825	44	44	2038	2038

\* 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 19 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.