

**Fecha de Publicación: 23 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 19 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\$396,7 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	69,1	88,5	62,5	43,1	131,6
15-35	115,5	140,1	120,1	95,5	235,6
36-60	3,4	0,4	0,4	3,4	3,8
61-90	0,9	0,1	0,1	0,9	1,0
91-180	21,3	1,5	1,5	21,3	22,8
>180	0,0	2,0	2,0	0,0	2,0
<b>Total</b>	<b>210,2</b>	<b>232,5</b>	<b>186,5</b>	<b>164,2</b>	<b>396,7</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11,1 %	2,7 %
15-35	4,2 %	4,6 %
36-60	5,4 %	5,1 %
61-90	0,9 %	2,5 %
91-180	1,4 %	3,5 %
>180	4,2 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</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>	21	19	986	1001	12	26	983	1078	14	30	980	1183
<b>Real</b>	19	21	953	939	26	12	947	852	30	14	1085	882
<b>Total</b>	40	40	1940	1940	38	38	1930	1930	44	44	2065	2065

\* 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 22 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.