

**Fecha de Publicación: 24 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 22 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\$396,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,3	122,1	102,1	18,3	140,3
15-35	130,6	124,2	100,2	106,6	230,8
36-60	3,4	4,0	4,0	3,4	7,4
61-90	0,8	0,3	0,3	0,8	1,1
91-180	6,7	4,1	4,1	6,7	10,8
>180	3,3	2,3	2,3	3,3	5,6
<b>Total</b>	<b>183,0</b>	<b>257,1</b>	<b>213,1</b>	<b>139,0</b>	<b>396,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,1 %	9,2 %
15-35	4,4 %	4,7 %
36-60	4,3 %	8,5 %
61-90	3,4 %	3,6 %
91-180	2,6 %	4,1 %
>180	3,9 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>6,4 %</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	5 al 9 de Noviembre				29 de Oct. al 2 de Noviembre				22 al 26 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	7	24	618	828	19	30	1007	1242	12	23	988	1143
<b>Real</b>	24	7	790	580	30	19	1124	889	23	12	1012	857
<b>Total</b>	31	31	1408	1408	49	49	2131	2131	36	36	2000	2000

\* 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 23 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.