

**Fecha de Publicación: 24 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 23 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\$329,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,8	15,2	15,2	15,8	31,0
15-35	129,4	147,4	124,4	106,4	253,9
36-60	20,5	0,3	0,3	20,5	20,8
61-90	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
91-180	8,7	13,9	13,9	8,7	22,7
>180	0,1	0,3	0,3	0,1	0,4
<b>Total</b>	<b>174,6</b>	<b>177,4</b>	<b>154,4</b>	<b>151,6</b>	<b>329,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,6 %	11,3 %
15-35	3,3 %	4,1 %
36-60	5,3 %	5,2 %
61-90	5,0 %	4,2 %
91-180	4,5 %	4,1 %
>180	8,0 %	11,4 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,9 %</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	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	624	841	18	30	1019	1256	13	21	991	1147
<b>Real</b>	24	7	803	586	30	18	1138	901	21	13	1016	860
<b>Total</b>	31	31	1427	1427	48	48	2157	2157	34	34	2007	2007

\* 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 24 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.