

**Fecha de Publicación: 30 de Octubre de 2007**  
**Fecha de Información: 26 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\$217,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,8	41,2	41,2	40,8	81,9
15-35	48,5	96,8	74,3	26,0	122,8
36-60	5,0	0,8	0,8	5,0	5,9
61-90	0,0	1,8	1,8	0,0	1,8
91-180	1,0	1,4	1,4	0,9	2,3
>180	0,4	2,1	2,1	0,4	2,5
<b>Total</b>	<b>95,6</b>	<b>144,2</b>	<b>121,6</b>	<b>73,1</b>	<b>217,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,2 %	4,0 %
15-35	3,8 %	4,6 %
36-60	5,2 %	5,8 %
61-90	5,0 %	4,4 %
91-180	5,2 %	4,7 %
>180	4,6 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>5,4 %</b>	<b>4,4 %</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	22 al 26 de Octubre				29 de Oct. al 2 de Noviembre				5 al 9 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	12	18	992	1150	20	30	1106	1355	7	24	714	908
<b>Real</b>	18	12	1019	862	30	20	1237	988	24	7	870	676
<b>Total</b>	30	30	2012	2012	50	50	2343	2343	31	31	1584	1584

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 29 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.