

**Fecha de Publicación: 2 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 31 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\$256,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7,6	10,4	10,4	7,6	18,1
15-35	56,2	146,1	138,1	48,2	194,3
36-60	16,0	5,3	5,3	16,0	21,3
61-90	0,0	6,7	6,7	0,0	6,7
91-180	1,9	10,5	10,5	1,9	12,4
>180	0,0	3,9	3,9	0,0	3,9
<b>Total</b>	<b>81,8</b>	<b>183,0</b>	<b>175,0</b>	<b>73,8</b>	<b>256,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,6 %	7,5 %
15-35	5,3 %	5,4 %
36-60	4,7 %	4,3 %
61-90	4,8 %	4,6 %
91-180	5,0 %	5,1 %
>180	5,3 %	5,1 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,4 %</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**

Sector	29 de Oct. al 2 de Noviembre				5 al 9 de Noviembre				12 al 16 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	21	25	1123	1379	4	24	801	939	29	34	781	888
<b>Real</b>	25	21	1261	1005	24	4	901	763	34	29	816	709
<b>Total</b>	46	46	2384	2384	29	29	1702	1702	63	63	1597	1597

\* 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 1 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.