

**Fecha de Publicación: 7 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 02 de Noviembre 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\$378,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,9	59,1	59,1	40,9	100,0
15-35	121,5	161,9	132,9	92,5	254,4
36-60	5,6	0,2	0,2	5,6	5,8
61-90	7,6	5,3	5,3	7,6	12,9
91-180	5,6	0,0	0,0	5,6	5,6
>180	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1
<b>Total</b>	<b>181,2</b>	<b>226,6</b>	<b>197,6</b>	<b>152,2</b>	<b>378,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,7 %	7,3 %
15-35	4,1 %	5,0 %
36-60	5,0 %	5,2 %
61-90	5,0 %	5,0 %
91-180	4,2 %	4,1 %
>180	4,1 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>5,6 %</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>	20	24	1124	1379	7	24	852	1030	31	34	809	961
<b>Real</b>	24	20	1261	1006	24	7	992	814	34	31	889	738
<b>Total</b>	44	44	2385	2385	32	32	1844	1844	65	65	1698	1698

\* 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 5 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.