

**Fecha de Publicación: 14 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 09 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\$458,4 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	49,7	48,4	48,4	49,7	98,2
15-35	159,8	182,3	164,3	141,8	324,1
36-60	2,1	0,0	0,0	2,1	2,1
61-90	4,9	4,4	4,4	4,9	9,3
91-180	7,1	1,3	1,3	7,1	8,4
>180	16,3	0,0	0,0	16,3	16,3
<b>Total</b>	<b>239,9</b>	<b>236,5</b>	<b>218,5</b>	<b>221,9</b>	<b>458,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,7 %	1,7 %
15-35	5,3 %	6,0 %
36-60	4,2 %	4,4 %
61-90	5,3 %	4,2 %
91-180	5,0 %	4,5 %
>180	4,2 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</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				12 al 16 de Noviembre				19 al 23 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	10	20	850	1038	45	38	906	1069	12	25	949	1031
<b>Real</b>	20	10	1000	812	38	45	988	824	25	12	938	857
<b>Total</b>	30	30	1850	1850	83	83	1894	1894	38	38	1887	1887

\* 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 12 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.