Información de mercado
República de Colombia
Ministerio de Hacienda y Crédito Público

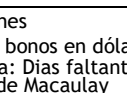
viernes, 22 de diciembre de 2023

Noticias del día

La inflación anual en Estados Unidos cayó por debajo del 3% en noviembre y las presiones sobre los precios también disminuyeron. Esto podría resultar en un recorte de las tasas de interés en marzo. Según la Oficina de Análisis Económico del Departamento de Comercio, la inflación medida por el índice de precios de los gastos de consumo personal (PCE) disminuyó un 0,1% el mes pasado, después de mantenerse sin cambios en octubre. En los últimos 12 meses hasta noviembre, el índice de precios PCE aumentó un 2,6%, siendo el primer mes desde marzo de 2021 en que estuvo por debajo del 3%. Finalmente, el Benchmark de los bonos a diez años cerró en 3,90% y una variación de 1 puntos básicos, mientras que el bono a 30 años cerró en 4,05% y una variación de 2 puntos básicos.

Según un sondeo de Reuters, se espera que el crecimiento económico de Rusia se desacelere en 2024 debido a las altas tasas de interés impuestas por el Banco de Rusia para controlar la inflación. Aunque se espera que el producto interior bruto supere las expectativas y crezca un 3,1% este año, se pronostica que el crecimiento se reducirá al 1,1% en 2024. Los altos tipos de interés están afectando las perspectivas de crecimiento y se espera que los costos de endeudamiento se mantengan elevados durante varios meses. En otras noticias, en el tercer trimestre, los precios de los inmuebles residenciales en Alemania cayeron un 10,2% en comparación con el año anterior, lo que representa la mayor caída desde que se comenzó a registrar en 2000, según los datos publicados por la Oficina Federal de Estadística.

El Departamento Nacional de Planeación (DNP) presentó el Corredor de Financiamiento Climático, una herramienta para identificar proyectos innovadores de financiación climática, clasificar iniciativas y trabajar con aceleradoras para fortalecer el trabajo en este campo. El objetivo es generar información sobre el mercado, atraer recursos, identificar barreras, aumentar la inversión y promover soluciones para cumplir las metas del país. El Corredor busca dinamizar la cadena de financiamiento climático y promover el acercamiento entre la oferta y la demanda. En otras noticias, el Ministerio de Comercio, Industria y Turismo presentó el Conpes de Reindustrialización, que busca invertir más de $7,8 billones en los próximos 10 años para promover una economía basada en el conocimiento y sostenible. El ministro Germán Umaña resaltó la importancia de contar con políticas integrales para fortalecer la producción nacional y mencionó la participación de diversas entidades y organizaciones en la elaboración del Conpes. Por último, el dólar spot tuvo una variación de -1,3% con respecto a la jornada anterior, cerrando en COP $3.901,00.



Los precios del petróleo subieron debido a las tensiones en Oriente Medio por los ataques de los hutíes en el Mar Rojo. Sin embargo, la decisión de Angola de abandonar la OPEP generó dudas sobre la eficacia del grupo para respaldar los precios. Más transportistas marítimos están evitando el Mar Rojo debido a los ataques de los hutíes, quienes dicen estar respondiendo a la guerra de Israel en Gaza. Los principales transportistas Maersk y CMA CGM anunciaron cargos adicionales por el desvío de barcos. Como resultado, el precio del crudo Brent subió 0,03% y alcanzó los 79,36 dólares por barril, mientras que el crudo estadounidense West Texas Intermediate (WTI) cayó un -0,1% y llegó a los 73,81 dólares por barril. Por último, el precio del oro tuvo una variación del 0,3% y cerró en 2.052,33 dólares por onza.

Tes Globales

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Duración	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
28-jun-27	9,85%	COP 1.924	3,52	1,67	96,07	11,22%	7 Pb

* El monto emitido en COP puede ser diferente del monto vigente por efecto de canjes y/o amortizaciones.

Bonos Globales denominados en Dólares

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Duración	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Año Corrido	Var. Anual Spreads
21-may-24	8,125%	USD 659	0,41	0,41	100,98	5,67%	24 Pb	-3 Pb	-121 Pb	-142 Pb
28-ene-26	4,500%	USD 1.500	2,10	1,15	97,93	5,55%	128 Pb	2 Pb	-116 Pb	-132 Pb
25-abr-27	3,875%	USD 1.897	3,34	1,90	95,03	5,52%	152 Pb	1 Pb	-141 Pb	-157 Pb
15-mar-29	4,500%	USD 2.000	5,23	2,70	93,12	6,05%	218 Pb	-1 Pb	-105 Pb	-116 Pb
30-ene-30	3,000%	USD 1.543	6,11	2,99	83,73	6,25%	236 Pb	-1 Pb	-99 Pb	-109 Pb
15-abr-31	3,125%	USD 2.540	7,31	3,66	80,90	6,44%	254 Pb	-2 Pb	-87 Pb	-92 Pb
22-abr-32	3,250%	USD 2.000	8,33	4,08	79,15	6,53%	263 Pb	-1 Pb	-86 Pb	-93 Pb
20-abr-33	8,000%	USD 1.624	9,33	4,46	108,54	6,75%	282 Pb	-2 Pb	-130 Pb	-135 Pb
2-feb-34	7,500%	USD 2.200	10,11	4,55	104,71	6,84%	294 Pb	-2 Pb	-114 Pb	N/A
14-nov-35	8,000%	USD 1.250	11,89	5,39	108,67	6,92%	295 Pb	-2 Pb	-43 Pb	N/A
18-sep-37	7,375%	USD 1.818	13,74	5,94	102,89	7,04%	302 Pb	-2 Pb	-108 Pb	-116 Pb
18-ene-41	6,125%	USD 2.500	17,07	6,89	89,92	7,16%	303 Pb	-2 Pb	-122 Pb	-131 Pb
22-feb-42	4,125%	USD 1.000	18,17	7,26	70,59	7,01%	286 Pb	-3 Pb	-100 Pb	-107 Pb
26-feb-44	5,625%	USD 2.500	20,18	7,91	82,89	7,25%	304 Pb	-3 Pb	-118 Pb	-126 Pb
15-jun-45	5,000%	USD 4.500	21,48	8,39	76,44	7,16%	298 Pb	-3 Pb	-98 Pb	-110 Pb
15-may-49	5,200%	USD 2.800	25,40	9,32	77,18	7,16%	304 Pb	-3 Pb	-110 Pb	-120 Pb
15-may-51	4,125%	USD 1.500	27,40	9,76	65,69	6,94%	285 Pb	-3 Pb	-77 Pb	-88 Pb
14-nov-53	8,750%	USD 1.250	29,89	10,40	114,18	7,55%	292 Pb	-60 Pb	-109 Pb	N/A
15-feb-61	3,875%	USD 1.300	37,15	10,93	61,57	6,69%	264 Pb	-4 Pb	-76 Pb	-85 Pb

Bono Global denominado en Euros

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Duración	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Año Corrido	Var. Anual Spreads
22-mar-26	3,875%	EUR 1.350	2,25	1,32	98,63	4,52%	220 Pb	-5 Pb	348 Pb	-137,16

* En millones

** Spread bonos en dólares sobre curva benchmark interpolada.
Vida Media: Dias faltantes al vencimiento/360
Duracion de Macaulay

Tasas de Interés y Rendimientos

Tasas de interés y rendimientos			
Indicador	22/12/2023	Variación diaria*	Variación Anual
FED Funds Rate	5,50	0 Pb	100 Pb
LIBOR 3 meses	5,62	-1 Pb	89 Pb
LIBOR 6 meses	5,64	-2 Pb	-511 Pb
SOFR *(overnight)*	5,31	0 Pb	101 Pb
Tesoros 2 años	4,33	-2 Pb	5 Pb
Tesoros 5 años	3,87	0 Pb	7 Pb
Tesoros 10 años	3,90	1 Pb	21 Pb
Tesoros 20 años	4,21	1 Pb	28 Pb
Tesoros 30 años	4,05	2 Pb	31 Pb

** La variación diaria es con respecto al día anterior.*

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	2.052,33	0,3%	14,5%
Petroleo WTI	73,81	-0,1%	-4,7%
Petroleo BRENT	79,36	0,0%	-2,0%
Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3.901,00	-1,3%	-18,1%
BRL	4,86	-0,4%	-6,0%
MXN	17,01	-0,1%	-13,0%
JPY	142,54	0,3%	7,7%
EUR	1,10	-0,1%	3,9%
Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	13,47	-1,3%	-38,7%
MOVE	111,93	0,0%	-0,1%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	37.288	-0,3%	12,9%
S&P	4.749	0,1%	24,2%
FTSE	7.698	0,0%	3,1%
Nikkei	33.169	0,1%	25,1%
MEX	57.362	-0,2%	14,5%
Bovespa	132.630	0,3%	23,3%
COLCAP	1.174	0,6%	-4,4%

Indicadores de Riesgo

EMBI+			
Indicador	22/12/2023	Variación diaria*	Variación Anual
EMBI G	320	-4 Pb	-63 Pb
EMBI G Colombia	280	-6 Pb	-99 Pb
EMBI+	345	-3 Pb	-32 Pb
EMBI+ Colombia	273	-5 Pb	-92 Pb
EMBI+ Perú	103	-3 Pb	-47 Pb
EMBI+ Brasil	194	-1 Pb	-73 Pb
EMBI+ México	166	-2 Pb	-36 Pb

** La variación diaria es con respecto al día anterior.*

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	159	-3 Pb	-122 Pb
CDS Perú	71	-1 Pb	-51 Pb
CDS Brasil	133	-2 Pb	-124 Pb
CDS México	90	0 Pb	-42 Pb
CDS Chile	51	0 Pb	-59 Pb

CONDICIONES DE USO

La Dirección General de Crédito Público y del Tesoro Nacional, por intermedio de la Subdirección de Financiamiento Externo de la Nación, distribuye informes públicos y periódicos donde se incluyen datos relacionados con el mercado secundario de los títulos de deuda pública externa de la República de Colombia, tales como precios, spreads y rendimientos. Estos informes son remitidos previa solicitud del interesado y dejarán de enviarse cuando éste lo solicite. Dichos documentos contienen información general y por lo tanto, no puede considerarse que mediante uno o varios de ellos se realice una promoción comercial, invitación, asesoría, oferta, garantía u obligación de la República de Colombia o del Ministerio de Hacienda y Crédito Público, para vender, comprar, mantener títulos de deuda pública externa, o celebrar operaciones con derivados, ofertas, promesas o cualquier tipo de contrato u operación financiera relacionada con los mismos. En consecuencia, la Nación-Ministerio de Hacienda y Crédito Público no asume ningún tipo de responsabilidad por las consecuencias derivadas de las acciones u omisiones que se hayan fundamentado en estos informes. Los títulos de deuda externa sobre los cuáles versan estos informes fueron emitidos y colocados en los mercados internacionales de capitales, por lo cual es posible que a su circulación y pago se apliquen normas correspondientes a jurisdicciones extranjeras; nada en este informe puede entenderse como una modificación a los contratos, anexos y demás documentos suscritos en ejecución o desarrollo de operaciones de crédito público, asimiladas o conexas, o como un concepto sobre la posibilidad de realizar transacciones relacionadas con estos títulos en Colombia. Las citas, transcripciones o cualquier tipo de referencia que se haga a todo o parte de estos informes, deberá señalar expresamente la aplicación de estos términos y condiciones.