miércoles, 2 de junio de 2021

Noticias del día

A pesar de que la economía estadounidense sigue recuperándose de la crisis del COVID-19 y el mercado laboral se acelera, el presidente del Banco de la Reserva Federal de Filadelfia, Patrick Harker, dijo que la Reserva Federal tiene previsto mantener la tasa de interés de los fondos federales baja durante mucho tiempo, pero que puede ser el momento de empezar a pensar, en reducir las compras mensuales de bonos del Tesoro y de valores respaldados por hipotecas, que ascienden a 120.000 millones de dólares. Sin embargo, se debe esperar la próxima reunión del 15 y 16 de junio. En relación con lo anterior, la Fed publicará su informe del Libro Beige, un resumen del estado de la actividad empresarial en los 12 distritos regionales del banco central. Finalmente, el rendimiento del Tesoro a 10 años bajó 2,4 puntos básicos, hasta 1,591%; este ha estado cotizando dentro de un rango del 1,55% al 1,64% durante más de una semana. La Bonos a dos años, que reflejan las expectativas de los inversionistas sobre las subidas de tasas, se situó en 0,145% y ha permanecido anclados desde que la Reserva Federal recortó las tasas de interés cerca de cero el año pasado.

El responsable del Banco Central Europeo (BCE), Jens Weidmann, piensa que el BCE debería comprar menos bonos de empresas contaminantes en el marco de los programas de estímulo del BCE, flexibilizando al parecer la postura del BCE y adoptando algún tipo de inclinación verde en sus programas multimillonarios de compra de bonos. Por otra parte, Alemania está estudiando la posibilidad de participar en un incremento de capital de 3.000 millones de euros en Lufthansa, según declaró el miércoles a Reuters el ministro de Finanzas, Olaf Scholz, una medida que podría ayudar a facilitar el rescate de la aerolínea que está respaldada por el Estado. Por último, Israel, país que ha utilizado mayormente la vacuna de Pfizer-BioNTech, señaló efectos secundarios cardiacos de esta vacuna. En los resultados presentados al Ministerio de Sanidad israelí, un grupo de investigación informó de 275 casos de inflamación del corazón (una enfermedad conocida como miocarditis) entre diciembre y mayo. De ellos, 148 se produjeron en el plazo de un mes tras la vacunación, y la mayoría se produjeron tras la segunda dosis.

Colombia aprobó la apertura gradual de la frontera con Venezuela; a través de la resolución 0746, expedida por el Ministerio del Interior, se permite el movimiento por tierra y agua. Por otra parte, el ministerio de Salud informó que, con corte de ayer, en Colombia se han aplicado más de 10,3 millones de dosis de la vacuna contra el COVID-19; el 1 de junio se aplicaron 290 mil. Finalmente, el peso colombiano continúa subiendo, datos del sistema Set-Fx indicaron que el dólar se cotizó en promedio $29,09 por debajo de la TRM de hoy y cerró en $3.642,29 en promedio.

En commodities, el petróleo amplió sus ganancias, ya que las señales de recuperación de la demanda desde Estados Unidos hasta Europa avivan el optimismo entre los productores y los analistas del mercado del crudo. El West Texas Intermediate para entrega en julio subió 1,11 dólares para cerrar en 68,83 dólares el barril. El Brent para entrega en agosto subió 1,10 dólares para terminar la sesión en 71,35 dólares el barril, el más alto desde mayo de 2019. Aprovechando los precios del petróleo, la petrolera brasileña Petrobras Global Finance BV recurrió al mercado de deuda especulativa ("junk market") con un nuevo bono de 1.500 millones de dólares a 30 años para comprar deuda vigente (“tender offer”) de 13 los bonos con vencimientos que van de 2024 a 2050, la oferta vence el 8 de junio a las 5 p.m. Nueva York. Con respecto a Irán, las potencias mundiales interrumpieron las conversaciones en Viena, pero tienen planes de regresar la próxima semana, ya que las diferencias entre Irán y Estados Unidos sobre cómo revivir un acuerdo nuclear histórico siguen retrasando el regreso de la República Islámica a los mercados del petróleo mundiales.

Tes Globales

Fecha de vencimient	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
21-mar-23	4,38%	COP 1.000	1,80	100,69	3,96%	4 Pb
28-jun-27	9,85%	COP 1.924	6,07	119,65	5,90%	4 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 vencimient	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Anual Spreads
15-mar-23	2,625%	USD 1.000	1,79	102,17	1,39%	108 Pb	0 Pb	-96 Pb
26-feb-24	4,000%	USD 1.566	2,73	106,08	1,71%	126 Pb	0 Pb	-85 Pb
21-may-24	8,125%	USD 1.000	2,97	118,27	1,78%	146 Pb	0 Pb	-101 Pb
28-ene-26	4,500%	USD 1.500	4,66	109,15	2,41%	164 Pb	-1 Pb	-71 Pb
25-abr-27	3,875%	USD 1.897	5,90	105,95	2,77%	178 Pb	0 Pb	-53 Pb
15-mar-29	4,500%	USD 2.000	7,79	108,32	3,28%	193 Pb	0 Pb	-59 Pb
30-ene-30	3,000%	USD 1.543	8,66	96,78	3,43%	199 Pb	0 Pb	-30 Pb
15-abr-31	3,125%	USD 2.540	9,87	96,58	3,54%	194 Pb	-2 Pb	-35 Pb
22-abr-32	3,250%	USD 2.000	10,89	96,45	3,65%	200 Pb	1 Pb	N/A
18-sep-37	7,375%	USD 1.818	16,29	129,58	4,75%	275 Pb	-3 Pb	-31 Pb
18-ene-41	6,125%	USD 2.500	19,63	116,09	4,84%	265 Pb	-2 Pb	-27 Pb
22-feb-42	4,125%	USD 1.000	20,72	95,34	4,47%	225 Pb	-2 Pb	N/A
26-feb-44	5,625%	USD 2.500	22,73	110,60	4,85%	262 Pb	-1 Pb	-20 Pb
15-jun-45	5,000%	USD 4.500	24,04	103,64	4,74%	251 Pb	0 Pb	-25 Pb
15-may-49	5,200%	USD 1.800	27,95	106,53	4,77%	249 Pb	-1 Pb	-19 Pb
15-may-51	4,125%	USD 1.500	29,95	91,59	4,65%	235 Pb	0 Pb	N/A
15-feb-61	3,875%	USD 1.300	39,70	85,68	4,67%	238 Pb	-1 Pb	N/A

Bono Global denominado en Euros

Fecha de vencimient	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Anual Spreads
22-mar-26	3,875%	EUR 1.350	4,81	111,39	1,41%	187 Pb	-2 Pb	-88 Pb

* En millones
** Spread bonos en dólares sobre curva benchmark interpolada.

Tasas de Interés y Rendimientos

Tasas de interés y rendimientos			
Indicador	Hoy (%)	Variación diaria	Variación Anual
FED Funds Rate	0,25		0 Pb
LIBOR 3 meses	0,13	0 Pb	-20 Pb
LIBOR 6 meses	0,17	0 Pb	-48 Pb
SOFR (*overnight*)	0,01	0 Pb	-6 Pb
Tesoros 2 años	0,15	0 Pb	-2 Pb
Tesoros 5 años	0,80	-1 Pb	48 Pb
Tesoros 10 años	1,59	-2 Pb	90 Pb
Tesoros 20 años	2,20	-1 Pb	95 Pb
Tesoros 30 años	2,28	-2 Pb	79 Pb

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1.908,38	0,4%	10,5%
Petroleo WTI	68,83	1,6%	87,0%
Petroleo BRENT	71,35	1,6%	80,3%
Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3.653,50	-0,3%	0,5%
BRL	5,08	-1,5%	-2,4%
MXN	19,90	-0,4%	-8,7%
JPY	109,56	0,1%	0,8%
EUR	1,22	0,0%	9,3%
Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	17,48	-2,3%	-34,9%
MOVE	55,21	0,4%	-0,3%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	34.600	0,1%	34,4%
S&P	4.208	0,1%	36,6%
FTSE	7.108	0,4%	14,3%
Nikkei	28.946	0,5%	29,7%
MEX	50.750	0,1%	35,5%
Bovespa	129.601	1,0%	42,3%
COLCAP	1.248	2,0%	11,7%

Indicadores de Riesgo

EMBI			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
EMBI G	304	-1 Pb	-145 Pb
EMBI G Colombi	245	-1 Pb	-32 Pb
EMBI+	348	-1 Pb	-93 Pb
EMBI+ Colombia	253	-1 Pb	-27 Pb
EMBI+ Perú	142	0 Pb	-6 Pb
EMBI+ Brasil	258	-2 Pb	-117 Pb
EMBI+ México	192	-1 Pb	-109 Pb

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	138	-2 Pb	-14 Pb
CDS Perú	91	-2 Pb	8 Pb
CDS Brasil	164	-4 Pb	-81 Pb
CDS México	92	0 Pb	-55 Pb
CDS Chile	66	-1 Pb	-17 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 titulos 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.