martes, 3 de agosto de 2021

Noticias del día

Los rendimientos de los bonos de referencia del tesoro de Estados Unidos a 10 años se situaron en 1,17%. En relación con la recuperación económica, la demanda de los estadounidenses por nuevos créditos aumentó, según informó la reserva federal de Nueva York, la deuda total de los hogares aumentó en USD 313.000 millones en el segundo trimestre, hasta alcanzar los USD 14,96 billones e incrementó el uso de tarjetas de crédito revirtiendo la tendencia a la baja observada a causa de la pandemia por COVID-19. Por otro lado, la presidenta de la reserva federal de San Francisco, Mary Daly, dijo que, a pesar de las quejas de los empresarios estadounidenses por la falta de trabajadores, hay casi 10 millones de personas desempleadas y que espera que esta situación mejore cuando la economía se recupere.

El Ministro de Finanzas alemán, Olaf Scholz, declaró que los habitantes de las zonas afectadas por las inundaciones del mes pasado podían contar con una ayuda de emergencia rápida y sin complicaciones por valor de más de EUR 400 millones, y que la reconstrucción global costaría probablemente más de EUR 6.000 millones. Por otra parte, el Fondo Monetario Internacional aprobó una asignación de 650.000 millones de dólares de Derechos Especiales de Giro del FMI, de los cuales unos 275.000 millones se destinarán a los mercados emergentes y países en desarrollo. Finalmente, Ruanda recaudó 620 millones de dólares a través de un eurobono a 10 años, según informó el Ministerio de Finanzas, parte de esta suma se destinará a la cancelación de un bono en dólares pendiente.

En Colombia, el equipo técnico del Banco de la República elevó su previsión de inflación para este año a 4,1%, desde un objetivo previo de 3%, a causa del aumento de los precios de los alimentos y el mayor crecimiento económico proyectado para 2021. Por otra parte, el Ministerio de Trabajo, el departamento de prosperidad social y la DIAN presentaron la cartilla de beneficios para empresas que contraten población vulnerable o joven, el documento tiene beneficios como exención de renta, descuentos tributarios y créditos fiscales. Por último, según el informe financiero del Banco de la República, las ganancias del Emisor en el primer semestre del año ascendieron a COP 524.218 millones, lo que supone una caída del 92,4% respecto al mismo periodo del año anterior, cuando las ganancias alcanzaron los COP 6,9 billones.

En commodities, el petróleo cayó a causa de la variante delta del COVID-19 que se extiende en China, las autoridades informaron de 61 casos confirmados y 23 infecciones asintomáticas, esto amenaza con poner en peligro la recuperación del consumo mundial. El Brent para la liquidación de octubre perdió 39 centavos hasta los USD 72,50 el barril; el WTI para entrega en septiembre cayó 70 centavos y se situó en 70,56 dólares el barril. Por otra parte, según la estimación promedio de analistas encuestados por Bloomberg, las reservas de crudo en Estados Unidos cayeron en 3 millones de barriles la semana pasada. Finalmente, 50 perforadores estadounidenses encuestados por BloombergNEF, se enfrentan a casi USD 12.000 millones en pérdidas por coberturas a través de derivados este año debido a malas inversiones en petróleo. Los perforadores estadounidenses aseguraron protección en promedio a USD 49,51 el barril.

Tes Globales

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
21-mar-23	4.38%	COP 1,000	1.63	100.32	4.16%	3 Pb
28-jun-27	9.85%	COP 1,924	5.90	118.49	6.03%	3 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	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Año Corrido	Var. Anual Spreads
15-mar-23	2.625%	USD 1,000	1.62	101.64	1.59%	129 Pb	4 Pb	51 Pb	-4 Pb
26-feb-24	4.000%	USD 1,566	2.56	104.83	2.06%	163 Pb	1 Pb	65 Pb	-5 Pb
21-may-24	8.125%	USD 1,000	2.80	116.85	1.91%	161 Pb	2 Pb	52 Pb	-31 Pb
28-ene-26	4.500%	USD 1,500	4.49	108.88	2.40%	176 Pb	1 Pb	48 Pb	-16 Pb
25-abr-27	3.875%	USD 1,897	5.73	106.10	2.72%	195 Pb	1 Pb	55 Pb	-9 Pb
15-mar-29	4.500%	USD 2,000	7.62	108.89	3.18%	216 Pb	-2 Pb	56 Pb	-6 Pb
30-ene-30	3.000%	USD 1,543	8.49	98.19	3.25%	218 Pb	0 Pb	63 Pb	7 Pb
15-abr-31	3.125%	USD 2,540	9.70	98.22	3.34%	218 Pb	3 Pb	66 Pb	5 Pb
22-abr-32	3.250%	USD 2,000	10.72	98.11	3.46%	224 Pb	4 Pb	N/A	N/A
18-sep-37	7.375%	USD 1,818	16.13	130.11	4.69%	315 Pb	2 Pb	74 Pb	34 Pb
18-ene-41	6.125%	USD 2,500	19.46	118.03	4.70%	297 Pb	1 Pb	70 Pb	30 Pb
22-feb-42	4.125%	USD 1,000	20.55	96.86	4.36%	260 Pb	0 Pb	N/A	N/A
26-feb-44	5.625%	USD 2,500	22.56	112.17	4.74%	296 Pb	1 Pb	78 Pb	38 Pb
15-jun-45	5.000%	USD 4,500	23.87	105.02	4.65%	286 Pb	2 Pb	78 Pb	45 Pb
15-may-49	5.200%	USD 1,800	27.78	108.43	4.66%	283 Pb	1 Pb	76 Pb	44 Pb
15-may-51	4.125%	USD 1,500	29.78	93.81	4.50%	266 Pb	2 Pb	78 Pb	40 Pb
15-feb-61	3.875%	USD 1,300	39.53	88.34	4.51%	267 Pb	1 Pb	N/A	N/A

Bono Global denominado en Euros

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Año Corrido	Var. Anual Spreads
22-mar-26	3.875%	EUR 1,350	4.64	110.94	1.42%	209 Pb	-3 Pb	39 Pb	-34 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	0.12	0 Pb	-13 Pb
LIBOR 6 meses	0.16	0 Pb	-30 Pb
SOFR (*overnight*)	0.05	0 Pb	-5 Pb
Tesoros 2 años	0.17	0 Pb	6 Pb
Tesoros 5 años	0.65	0 Pb	43 Pb
Tesoros 10 años	1.17	-1 Pb	62 Pb
Tesoros 20 años	1.75	0 Pb	75 Pb
Tesoros 30 años	1.84	-1 Pb	61 Pb

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1,810.44	-0.2%	-8.4%
Petroleo WTI	70.56	-1.0%	72.1%
Petroleo BRENT	72.41	-0.7%	64.0%
Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3,909.75	0.5%	3.7%
BRL	5.20	0.4%	-2.3%
MXN	19.89	-0.1%	-12.1%
JPY	109.04	-0.2%	2.9%
EUR	1.19	-0.1%	0.9%
Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	18.04	-7.3%	-25.7%
MOVE	65.42	1.8%	51.7%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	35,116	0.8%	31.7%
S&P	4,423	0.8%	34.3%
FTSE	7,106	0.3%	17.8%
Nikkei	27,642	-0.5%	24.5%
MEX	51,634	1.5%	37.5%
Bovespa	123,577	0.9%	20.2%
COLCAP	1,236	0.0%	9.0%

Indicadores de Riesgo

EMBI			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
EMBI G	326	-1 Pb	-71 Pb
EMBI G Colombia	276	0 Pb	28 Pb
EMBI+	368	-1 Pb	-43 Pb
EMBI+ Colombia	281	1 Pb	29 Pb
EMBI+ Perú	156	-6 Pb	40 Pb
EMBI+ Brasil	304	2 Pb	-25 Pb
EMBI+ México	219	-2 Pb	-62 Pb

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	145	-1 Pb	16 Pb
CDS Perú	94	-4 Pb	15 Pb
CDS Brasil	178	0 Pb	-39 Pb
CDS México	95	0 Pb	-48 Pb
CDS Chile	69	-1 Pb	-1 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.