

Noticias del día



En Estados Unidos, el presidente de la Reserva Federal, Jerome Powell, pidió un estímulo fiscal y monetario agresivo y continuo para lograr una recuperación económica que, según indicó, todavía tiene "un largo camino por recorrer". En contraste, el presidente, Donald Trump, ordenó la suspensión de las negociaciones con los legisladores demócratas sobre el paquete de alivio ante el COVID-19 hasta después de las elecciones. En otras noticias, el Departamento de Comercio anunció que el déficit comercial aumentó un 5,9% a USD 67.100 millones dado el incremento en las importaciones, el mayor desde agosto de 2006.



En Europa, la presidenta del Banco Central Europeo (BCE), Christine Lagarde, dijo que una segunda ola de la pandemia de COVID-19 retrasaría la recuperación económica de la zona euro. En otras noticias, la rentabilidad bancaria de la zona euro se desplomó en el segundo trimestre; las estadísticas trimestrales del BCE mostraron que el retorno sobre el capital en la primera mitad del año fue del 0,01%, muy por debajo del 6,01% del año anterior, con al menos siete de los 19 países de la zona euro presentando rendimientos negativos. Por último, el portavoz del primer ministro, Boris Johnson, dijo que Reino Unido necesita saber antes del 15 de octubre si habrá un acuerdo con la Unión Europea porque las empresas deben prepararse.



En Colombia, la inflación para el mes de septiembre se ubicó en 0,32%, subiendo a valores positivos después de cuatro meses; de acuerdo con el DANE, la variación anual del IPC fue de 1,97%, es decir, 1,85 puntos porcentuales menor que la reportada en el mismo periodo del año anterior, cuando fue de 3,82%. Por su parte, la cifra para el año corrido se ubicó en 1,44%. En otras noticias, Juan José Echavarría, Gerente del Banco de la República, afirmó ante la Comisión Tercera del Senado que las medidas de liquidez tomadas para fortalecer la economía durante la pandemia de COVID-19, representan cerca de 3,7% del PIB.



Con respecto a commodities, los precios del petróleo subieron más del 2%, apoyados por las interrupciones de suministro previstas por el huracán "Delta" que amenaza el Golfo de México y una huelga de trabajadores petroleros en Noruega que podría ampliarse a partir del 10 de octubre. En otras noticias, de acuerdo con la Administración de Información de Energía de Estados Unidos (EIA), se espera que la producción de petróleo crudo de EE.UU., caiga en 800.000 barriles por día (bpd) este año a 11,45 millones de bpd, así mismo, se espera que la producción de gas seco disminuya a 90,640 millones de pies cúbicos por día (bcfd) en 2020.

Tes Globales

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	Spread TES
14-abr-21	7,75%	COP 2.467	0,52	102,04	3,63%	3 Pb
21-mar-23	4,38%	COP 1.000	2,45	101,17	3,86%	3 Pb
28-jun-27	9,85%	COP 1.924	6,73	127,87	4,88%	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. Anual Spreads
12-jul-21	4,375%	USD 1.486	0,77	102,66	0,88%	74 Pb	-3 Pb	-15 Pb
15-mar-23	2,625%	USD 1.000	2,44	102,53	1,57%	129 Pb	-3 Pb	26 Pb
26-feb-24	4,000%	USD 2.100	3,39	106,68	1,95%	160 Pb	0 Pb	44 Pb
21-may-24	8,125%	USD 1.000	3,63	120,83	2,12%	189 Pb	1 Pb	67 Pb
28-ene-26	4,500%	USD 1.500	5,31	110,84	2,32%	190 Pb	1 Pb	57 Pb
25-abr-27	3,875%	USD 2.400	6,55	108,21	2,51%	201 Pb	5 Pb	66 Pb
15-mar-29	4,500%	USD 2.000	8,44	112,47	2,83%	218 Pb	4 Pb	71 Pb
30-ene-30	3,000%	USD 1.543	9,32	102,44	2,70%	202 Pb	4 Pb	N/A
15-abr-31	3,125%	USD 1.000	10,53	102,81	2,81%	205 Pb	5 Pb	N/A
18-sep-37	7,375%	USD 1.818	16,95	141,05	4,01%	287 Pb	3 Pb	69 Pb
18-ene-41	6,125%	USD 2.500	20,28	129,31	4,00%	269 Pb	3 Pb	61 Pb
26-feb-44	5,625%	USD 2.500	23,39	124,58	4,00%	260 Pb	0 Pb	59 Pb
15-jun-45	5,000%	USD 4.500	24,69	117,15	3,91%	249 Pb	4 Pb	57 Pb
15-may-49	5,200%	USD 1.800	28,61	120,90	3,97%	246 Pb	6 Pb	58 Pb
15-may-51	4,125%	USD 1.500	30,61	104,23	3,89%	229 Pb	-1 Pb	N/A

Bono Global denominado en Euros

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Anual Spreads
22-mar-26	3,875%	EUR 1.350	5,46	111,55	1,56%	228 Pb	1 Pb	88 Pb

* En millones

** Spread sobre curva UST interpolada.

Tasas de Interés y Rendimientos

Tasas de interés y rendimientos			
Indicador	Hoy (%)	Variación diaria	Variación Anual
FED Funds Rate	0,25		-175 Pb
LIBOR 3 meses	0,22	0 Pb	-181 Pb
LIBOR 6 meses	0,23	0 Pb	-195 Pb
SOFR (overnight)	0,09	0 Pb	-173 Pb
Tesoros 2 años	0,15	0,0 Pb	-126 Pb
Tesoros 5 años	0,31	-2,4 Pb	-104 Pb
Tesoros 10 años	0,74	-4,6 Pb	-79 Pb

Commodities, Divisas y Volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1.878,18	-1,8%	24,8%
Petroleo WTI	40,67	3,7%	-23,0%
Petroleo BRENT	42,65	3,3%	-26,9%

Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3.833,00	0,1%	11,6%
BRL	5,59	0,3%	37,9%
MXN	21,73	1,5%	11,3%
JPY	105,63	-0,1%	-1,2%
EUR	1,17	-0,4%	6,9%

VIX			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	29,48	5,4%	73,0%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	27.773	-1,3%	4,5%
S&P	3.361	-1,4%	13,9%
FTSE	5.950	0,1%	-16,8%
Nikkei	23.434	0,5%	9,5%
MEX	36.948	0,6%	-14,9%
Bovespa	95.615	-0,5%	-6,8%
COLCAP	1.169	0,1%	-26,6%

Indicadores de Riesgo

EMBI			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
EMBI G	388	0 Pb	39 Pb
EMBI G Colombia	256	4 Pb	68 Pb
EMBI+	405	2 Pb	-3 Pb
EMBI+ Colombia	259	3 Pb	71 Pb
EMBI+ Peru	129	5 Pb	25 Pb
EMBI+ Brasil	329	0 Pb	67 Pb
EMBI+ México	273	4 Pb	62 Pb

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	135	-4 Pb	41 Pb
CDS Perú	72	-2 Pb	12 Pb
CDS Brasil	232	-5 Pb	94 Pb
CDS México	135	-3 Pb	20 Pb
CDS Chile	62	-2 Pb	25 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 cuales 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.