

Noticias del día



El Senado de EE.UU. aplazó la votación sobre el techo de la deuda para evitar el default de la deuda federal ya que, el partido demócrata está considerando una propuesta republicana que podría calmar el conflicto bipartidista que amenaza a la economía en general. Por otra parte, la secretaria del Tesoro de EE.UU., Janet Yellen, dijo al ministro de Finanzas de Estonia, Keit Pentus-Rosimannus, que era importante llegar a un acuerdo para remodelar el sistema fiscal mundial y garantizar que las empresas paguen una cantidad razonable. Por último, el informe nacional de empleo de ADP mostró que las nóminas privadas estadounidenses aumentaron más de lo previsto en septiembre, y alcanzaron los 568.000 empleos.



En Europa, la inflación anual en Rusia se elevó al 7,40% en septiembre, su máximo desde junio de 2016, y mostró signos de seguir subiendo en octubre, lo que añade presión al banco central para que suba las tasas de interés por sexta vez este año. En cuanto a rendimientos de la zona euro, la deuda pública alemana a 10 años, subió 4 puntos básicos y alcanzó su máximo desde finales de junio, situándose en -0,147%. Finalmente, el Banco Nacional de Polonia subió inesperadamente 40 puntos básicos su tasa de interés de referencia, uniéndose a sus pares de Europa central en el endurecimiento de la política monetaria.



En Colombia, según el reporte de inflaciones básicas de septiembre entregado por el Banco de la República, la inflación básica de alimentos y de alimentos no regulados presentaron variaciones anuales de 12,40 % y 9,02 % respectivamente, cifras que representan máximos desde 2016, cabe mencionar que para el mismo periodo del año 2020 la inflación básica de alimentos fue del 4,13% y la de alimentos sin regular fue del 2,58%. En otras noticias, según datos publicados por el Ministerio de Hacienda, Colombia hizo por primera vez uso de las cláusulas de conversión de moneda disponibles en los contratos de préstamo con el Banco Interamericano de Desarrollo y el Banco Internacional de Reconstrucción y Fomento, para convertir a tasa fija en pesos colombianos, dos préstamos multilaterales por USD 244.630.615 con vencimientos en 2031 y 2033. Por otra parte, el Banco Mundial revisó al alza el crecimiento de la economía colombiana para 2022, pues con una cifra de 4,2% Colombia lideraría el crecimiento de la región. Así mismo, la calificadora Moody's mantuvo la calificación de Colombia en Baa2 y elevó la perspectiva de negativa a estable.



El petróleo registró la mayor caída en dos semanas tras un aumento de los inventarios en Estados Unidos y después de que Rusia señalara que está dispuesta a ayudar a aliviar la crisis energética mundial. El West Texas Intermediate para entrega en noviembre cayó USD 1,50 y se situó en USD 77,43 el barril; el Brent para entrega en diciembre bajó USD 1,48 y terminó la sesión en USD 81,08 el barril. El oro bajó tras aumentar por tres días consecutivos, ya que los rendimientos del tesoro subieron después de que el indicador de actividad económica del sector de servicios en Estados Unidos, superar las expectativas y aumentara el optimismo sobre la reactivación económica, el oro al contado bajó 0,4% a USD 1.762,72 a onza, los lingotes para entrega en diciembre cayeron 0,4% para ubicarse en USD 1.760,9 en el Comex. Finalmente, el viceprimer ministro ruso, Alexander Novak, dijo que la certificación del gasoducto submarino Nord Stream 2, que espera el visto bueno del regulador alemán, podría servir para reducir los precios del gas en Europa.

Tes Globales

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
21-mar-23	4.38%	COP 1,000	1.45	99.92	4.42%	4 Pb
28-jun-27	9.85%	COP 1,924	5.73	117.61	6.10%	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 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	1.44	101.39	1.65%	131 Pb	0 Pb	53 Pb	2 Pb
26-feb-24	4.000%	USD 1,566	2.39	104.48	2.07%	152 Pb	0 Pb	53 Pb	-9 Pb
21-may-24	8.125%	USD 1,000	2.63	115.41	2.06%	160 Pb	-3 Pb	50 Pb	-29 Pb
28-ene-26	4.500%	USD 1,500	4.31	107.07	2.75%	187 Pb	-1 Pb	59 Pb	-3 Pb
25-abr-27	3.875%	USD 1,897	5.55	103.61	3.16%	209 Pb	-2 Pb	70 Pb	8 Pb
15-mar-29	4.500%	USD 2,000	7.44	105.41	3.66%	231 Pb	0 Pb	71 Pb	13 Pb
30-ene-30	3.000%	USD 1,543	8.32	94.36	3.80%	239 Pb	-1 Pb	84 Pb	37 Pb
15-abr-31	3.125%	USD 2,540	9.53	93.57	3.94%	244 Pb	0 Pb	93 Pb	40 Pb
22-abr-32	3.250%	USD 2,000	10.54	93.38	4.03%	247 Pb	-1 Pb	N/A	N/A
18-sep-37	7.375%	USD 1,818	15.95	123.13	5.22%	339 Pb	0 Pb	98 Pb	52 Pb
18-ene-41	6.125%	USD 2,500	19.28	110.32	5.27%	327 Pb	0 Pb	100 Pb	58 Pb
22-feb-42	4.125%	USD 1,000	20.38	90.46	4.87%	284 Pb	0 Pb	N/A	N/A
26-feb-44	5.625%	USD 2,500	22.39	104.95	5.25%	321 Pb	0 Pb	102 Pb	60 Pb
15-jun-45	5.000%	USD 4,500	23.69	98.13	5.14%	309 Pb	0 Pb	101 Pb	60 Pb
15-may-49	5.200%	USD 1,800	27.61	100.14	5.19%	313 Pb	1 Pb	105 Pb	66 Pb
15-may-51	4.125%	USD 1,500	29.61	86.87	4.98%	290 Pb	0 Pb	102 Pb	55 Pb
15-feb-61	3.875%	USD 1,300	39.36	81.72	4.93%	285 Pb	0 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	4.46	110.32	1.46%	195 Pb	4 Pb	25 Pb	-30 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	-11 Pb
LIBOR 6 meses	0.16	0 Pb	-24 Pb
SOFR (overnight)	0.05	0 Pb	-5 Pb
Tesoros 2 años	0.30	1 Pb	15 Pb
Tesoros 5 años	0.99	1 Pb	67 Pb
Tesoros 10 años	1.52	-1 Pb	79 Pb
Tesoros 20 años	2.03	-1 Pb	72 Pb
Tesoros 30 años	2.08	-2 Pb	54 Pb

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1,762.74	0.1%	-6.1%
Petroleo WTI	77.43	-1.9%	90.4%
Petroleo BRENT	81.08	-1.8%	90.1%

Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3,788.00	0.1%	-1.2%
BRL	5.49	0.3%	-1.8%
MXN	20.55	-0.1%	-5.4%
JPY	111.41	0.0%	5.5%
EUR	1.16	-0.4%	-1.5%

Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	21.00	-1.4%	-28.8%
MOVE	60.65	-3.5%	5.0%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	34,417	0.3%	23.9%
S&P	4,364	0.4%	29.8%
FTSE	6,996	-1.1%	17.6%
Nikkei	27,529	-1.1%	17.5%
MEX	50,974	-0.2%	38.0%
Bovespa	110,560	0.1%	15.6%
COLCAP	1,382	-0.1%	18.2%

Indicadores de Riesgo

EMBI			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
EMBI G	333	5 Pb	-55 Pb
EMBI G Colombia	298	1 Pb	47 Pb
EMBI+	382	5 Pb	-23 Pb
EMBI+ Colombia	303	1 Pb	49 Pb
EMBI+ Perú	153	2 Pb	26 Pb
EMBI+ Brasil	334	2 Pb	6 Pb
EMBI+ México	221	4 Pb	-49 Pb

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	173	0 Pb	38 Pb
CDS Perú	105	0 Pb	32 Pb
CDS Brasil	209	2 Pb	-23 Pb
CDS México	101	0 Pb	-34 Pb
CDS Chile	88	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.