

Noticias del día



Después del pronunciamiento de FedEx sobre una desaceleración de la demanda mundial, el rendimiento del bono del Tesoro estadounidense a dos años subió 3,2 puntos básicos, a un 3,905%, mientras que el de 10 años, ganaba 1,8 puntos básicos, a un 3,477%. La brecha entre los rendimientos a 2 y 10 años se amplió a -43,2 puntos básicos. Asimismo, el rendimiento de los bonos a 30 años sumó 4,8 puntos básicos, a un 3,528%. Por otro lado, el índice del dólar subió un 0,009%. En otras noticias, según el índice del consumidor de la Universidad de Michigan, el cual califica el nivel relativo de las condiciones económicas actuales y futuras, la confianza del consumidor en EE. UU. mejoró en el último mes, pasando de 58,2 a 59,5, un máximo de cinco meses, como consecuencia de la caída prolongada de los precios de la gasolina que alivió la presión sobre los estadounidenses; la encuesta también mostró expectativas de moderación de la inflación en el mediano plazo, cayendo a 2,8% para los próximos cinco años, desde 2,9% hace un mes, lo cual sugiere que la mayoría de los consumidores estadounidenses todavía esperan que la Reserva Federal reduzca la inflación desde su máximo actual en 40 años.



En Europa la libra esterlina cayó el viernes a un nuevo mínimo de 37 años frente al dólar, y un mínimo de 17 meses frente al euro, llegando a caer más de un 1% frente al dólar a 1,1351 dólares. Por otra parte, el presidente del Consejo Europeo insta a la UE a actuar junta en la crisis energética; el ejecutivo de la UE ha propuesto recaudar más de 140.000 millones de euros (139.400 millones de dólares) para proteger a los consumidores de la subida de los precios de la energía. Asimismo, Italia aprobó el viernes un nuevo paquete de ayudas por valor de unos 14.000 millones de euros (13.970 millones de dólares) para proteger a las empresas y a las familias del aumento de los costes de la energía y de los precios al consumo, según responsables del Gobierno a Reuters.



En Colombia este viernes se conocieron los datos de la balanza comercial. Según el Departamento Administrativo Nacional de Estadística (DANE), las importaciones crecieron 44,3% a US\$45.397,1 millones en julio de 2022 frente al mismo periodo del 2021, mientras que las exportaciones en julio subieron 71,7% a USD 5.913.937 M, lo cual representa un déficit comercial de US \$ 494,2 millones. Por su parte, las importaciones del grupo de combustibles y productos de las industrias extractivas fueron de US\$871,1 millones y presentaron un aumento de 215,5%, en comparación con julio de 2021. Los productos que más contribuyeron al aumento fueron petróleo, productos derivados del petróleo y productos conexos (316,9%), que aportaron 204,9 puntos porcentuales a la variación total del grupo. Por otro lado, en entrevista con Bloomberg el ministro de Hacienda y Crédito público de Colombia, José Antonio Ocampo, se pronunció acerca de la inflación y como se espera que Colombia logre recaudar alrededor de US \$1.500 millones en el mercado global de capitales para el 2023. Respecto a noticias de la región, el Banco Central de Perú



El precio del petróleo intermedio de Texas (WTI) registró este viernes una leve subida del 0,26 %, hasta los \$85,32 dólares el barril, pero en camino de cerrar el global semanal con pérdidas por las renovadas preocupaciones por la caída de la demanda internacional. Mientras tanto, los futuros del crudo WTI para entrega en octubre ganaron 1 centavo, o un 0,01%, a \$85,11 dólares y los futuros del crudo Brent subieron 51 centavos, o un 0,56%, a \$91,35 dólares el barril. Respecto al oro al contado, este subió un 0,6% a \$1.673,19 dólares por onza, mientras que los futuros del oro en Estados Unidos ganaron un 0,3% a \$1.682,10 dólares.

Tes Globales

| Fecha de vencimiento | Cupón | Vigente* | Vida Media | Precio | Rendimiento | Spread sobre TES |
|----------------------|-------|-----------|------------|--------|-------------|------------------|
| 21-mar-23 | 4,38% | COP 1.000 | 0,51 | 95,74 | 13,01% | 13 Pb |
| 28-jun-27 | 9,85% | COP 1.924 | 4,78 | 88,46 | 13,23% | 9 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 | 0,50 | 98,78 | 5,15% | 142 Pb | 5 Pb | 4 Pb | 23 Pb |
| 26-feb-24 | 4,000% | USD 1.566 | 1,44 | 97,64 | 5,72% | 182 Pb | 13 Pb | 14 Pb | 36 Pb |
| 21-may-24 | 8,125% | USD 1.000 | 1,68 | 103,31 | 6,01% | 210 Pb | 15 Pb | 44 Pb | 63 Pb |
| 28-ene-26 | 4,500% | USD 1.500 | 3,37 | 94,42 | 6,36% | 258 Pb | 11 Pb | 45 Pb | 89 Pb |
| 25-abr-27 | 3,875% | USD 1.897 | 4,61 | 89,03 | 6,68% | 302 Pb | 12 Pb | 57 Pb | 112 Pb |
| 15-mar-29 | 4,500% | USD 2.000 | 6,50 | 87,19 | 6,99% | 341 Pb | 9 Pb | 76 Pb | 136 Pb |
| 30-ene-30 | 3,000% | USD 1.543 | 7,37 | 76,48 | 7,16% | 362 Pb | 25 Pb | 81 Pb | 150 Pb |
| 15-abr-31 | 3,125% | USD 2.540 | 8,58 | 74,48 | 7,16% | 366 Pb | 11 Pb | 77 Pb | 150 Pb |
| 22-abr-32 | 3,250% | USD 2.000 | 9,60 | 73,15 | 7,17% | 371 Pb | 10 Pb | 81 Pb | 152 Pb |
| 18-sep-37 | 7,375% | USD 1.818 | 15,01 | 93,08 | 8,18% | 456 Pb | 12 Pb | 58 Pb | 140 Pb |
| 18-ene-41 | 6,125% | USD 2.500 | 18,34 | 78,83 | 8,41% | 468 Pb | 11 Pb | 76 Pb | 162 Pb |
| 22-feb-42 | 4,125% | USD 1.000 | 19,43 | 61,86 | 8,04% | 427 Pb | 15 Pb | 78 Pb | 161 Pb |
| 26-feb-44 | 5,625% | USD 2.500 | 21,44 | 71,28 | 8,57% | 483 Pb | 13 Pb | 94 Pb | 181 Pb |
| 15-jun-45 | 5,000% | USD 4.500 | 22,75 | 66,57 | 8,29% | 458 Pb | 13 Pb | 80 Pb | 165 Pb |
| 15-may-49 | 5,200% | USD 2.800 | 26,66 | 67,50 | 8,22% | 462 Pb | 11 Pb | 81 Pb | 168 Pb |
| 15-may-51 | 4,125% | USD 1.500 | 28,66 | 59,24 | 7,65% | 411 Pb | 9 Pb | 67 Pb | 133 Pb |
| 15-feb-61 | 3,875% | USD 1.300 | 38,41 | 56,40 | 7,26% | 374 Pb | 9 Pb | 45 Pb | 95 Pb |

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 | 3,52 | 95,38 | 5,35% | 384 Pb | -8 Pb | 161 Pb | 197 Pb |

* En millones

** Spread bonos en dólares sobre curva benchmark interpolada.

Tasas de Interés y Rendimientos

| Tasas de interés y rendimientos | | | |
|---------------------------------|------------|-------------------|-----------------|
| Indicador | 15/09/2022 | Variación diaria* | Variación Anual |
| FED Funds Rate | 2,50 | 0 Pb | 225 Pb |
| LIBOR 3 meses | 3,53 | 4 Pb | 341 Pb |
| LIBOR 6 meses | 4,06 | 5 Pb | -11 Pb |
| SOFR (overnight) | 2,28 | 1 Pb | 223 Pb |
| Tesoros 2 años | 3,87 | 0 Pb | 365 Pb |
| Tesoros 5 años | 3,64 | -3 Pb | 277 Pb |
| Tesoros 10 años | 3,46 | 0 Pb | 209 Pb |
| Tesoros 20 años | 3,79 | 4 Pb | 194 Pb |
| Tesoros 30 años | 3,52 | 5 Pb | 162 Pb |

* La variación diaria es con respecto al día anterior.

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

| Commodities | | | |
|----------------|----------|------------------|-----------------|
| Indicador | Hoy | Variación diaria | Variación Anual |
| Oro | 1.675,06 | 0,6% | -4,5% |
| Petroleo WTI | 85,35 | 0,3% | 18,6% |
| Petroleo BRENT | 91,56 | 0,8% | 21,5% |

| Monedas Spot | | | |
|--------------|----------|------------------|-----------------|
| Indicador | Hoy | Variación diaria | Variación Anual |
| COP | 4.435,20 | 0,4% | 15,8% |
| BRL | 5,25 | 0,1% | -0,7% |
| MXN | 20,04 | -0,2% | 0,1% |
| JPY | 142,92 | -0,4% | 30,0% |
| EUR | 1,00 | 0,1% | -14,6% |

| Indicadores de volatilidad | | | |
|----------------------------|--------|------------------|-----------------|
| Indicador | Hoy | Variación diaria | Variación Anual |
| VIX | 26,30 | 0,1% | 26,4% |
| MOVE | 124,95 | 0,7% | 122,9% |

Renta Variable

| Mercado Accionario | | | |
|--------------------|---------|------------------|-----------------|
| Indicador | Hoy | Variación diaria | Variación Anual |
| Dow Jones | 30.822 | -0,5% | -10,9% |
| S&P | 3.873 | -0,7% | -12,6% |
| FTSE | 7.237 | -0,6% | 3,9% |
| Nikkei | 27.568 | -1,1% | -9,6% |
| MEX | 46.770 | 0,0% | -8,8% |
| Bovespa | 109.280 | -0,6% | -1,9% |
| COLCAP | 1.210 | -0,3% | -8,5% |

Indicadores de Riesgo

| EMBI | | | |
|-----------------|------------|-------------------|-----------------|
| Indicador | 15/09/2022 | Variación diaria* | Variación Anual |
| EMBI G | 415 | -1 Pb | 103 Pb |
| EMBI G Colombia | 397 | -2 Pb | 118 Pb |
| EMBI+ | 423 | -1 Pb | 70 Pb |
| EMBI+ Colombia | 380 | -2 Pb | 97 Pb |
| EMBI+ Perú | 185 | 0 Pb | 49 Pb |
| EMBI+ Brasil | 261 | -2 Pb | -51 Pb |
| EMBI+ México | 234 | -1 Pb | 26 Pb |

* La variación diaria es con respecto al día anterior.

| CDS 5 años | | | |
|--------------|-----|------------------|-----------------|
| Indicador | Hoy | Variación diaria | Variación Anual |
| CDS Colombia | 258 | 4 Pb | 124 Pb |
| CDS Perú | 125 | 4 Pb | 40 Pb |
| CDS Brasil | 246 | 3 Pb | 66 Pb |
| CDS México | 156 | 3 Pb | 74 Pb |
| CDS Chile | 134 | 3 Pb | 67 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.