

Tes Globales

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
21-mar-23	4,38%	COP 1.000	0,65	95,82	11,14%	9 Pb
28-jun-27	9,85%	COP 1.924	4,92	88,93	13,03%	7 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	0,63	98,86	4,48%	165 Pb	-28 Pb	28 Pb	32 Pb
26-feb-24	4,000%	USD 1.566	1,58	98,08	5,28%	240 Pb	-10 Pb	72 Pb	75 Pb
21-may-24	8,125%	USD 1.000	1,81	104,77	5,32%	244 Pb	-10 Pb	77 Pb	85 Pb
28-ene-26	4,500%	USD 1.500	3,50	95,57	5,92%	315 Pb	-4 Pb	102 Pb	134 Pb
25-abr-27	3,875%	USD 1.897	4,74	90,96	6,10%	339 Pb	-6 Pb	95 Pb	140 Pb
15-mar-29	4,500%	USD 2.000	6,63	89,84	6,40%	370 Pb	-5 Pb	105 Pb	150 Pb
30-ene-30	3,000%	USD 1.543	7,51	79,90	6,42%	372 Pb	-5 Pb	91 Pb	152 Pb
15-abr-31	3,125%	USD 2.540	8,71	78,12	6,44%	376 Pb	-6 Pb	87 Pb	156 Pb
22-abr-32	3,250%	USD 2.000	9,73	76,96	6,48%	380 Pb	-7 Pb	91 Pb	157 Pb
18-sep-37	7,375%	USD 1.818	15,14	97,00	7,71%	474 Pb	-4 Pb	76 Pb	160 Pb
18-ene-41	6,125%	USD 2.500	18,47	82,87	7,90%	474 Pb	-5 Pb	83 Pb	176 Pb
22-feb-42	4,125%	USD 1.000	19,57	66,88	7,34%	412 Pb	-5 Pb	63 Pb	149 Pb
26-feb-44	5,625%	USD 2.500	21,58	76,90	7,87%	467 Pb	-12 Pb	78 Pb	169 Pb
15-jun-45	5,000%	USD 4.500	22,88	71,74	7,63%	446 Pb	-11 Pb	67 Pb	159 Pb
15-may-49	5,200%	USD 2.800	26,80	72,60	7,61%	452 Pb	-9 Pb	71 Pb	167 Pb
15-may-51	4,125%	USD 1.500	28,80	64,84	6,97%	392 Pb	-8 Pb	49 Pb	124 Pb
15-feb-61	3,875%	USD 1.300	38,55	61,77	6,63%	361 Pb	-4 Pb	32 Pb	92 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	3,65	96,04	5,09%	476 Pb	-7 Pb	253 Pb	265 Pb

* En millones

** Spread bonos en dólares sobre curva benchmark interpolada.

Tasas de Interés y Rendimientos

Tasas de interés y rendimientos			
Indicador	27/07/2022	Variación diaria*	Variación Anual
FED Funds Rate	2,50	75 Pb	225 Pb
LIBOR 3 meses	2,81	1 Pb	268 Pb
LIBOR 6 meses	3,37	2 Pb	-12 Pb
SOFR (overnight)	1,53	0 Pb	148 Pb
Tesoros 2 años	2,87	-13 Pb	266 Pb
Tesoros 5 años	2,70	-14 Pb	196 Pb
Tesoros 10 años	2,68	-11 Pb	141 Pb
Tesoros 20 años	3,24	-6 Pb	140 Pb
Tesoros 30 años	3,03	-4 Pb	111 Pb

* La variación diaria es con respecto al día anterior.

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1.755,84	1,2%	-4,0%
Petroleo WTI	96,42	-0,9%	31,0%
Petroleo BRENT	107,84	1,1%	41,8%

Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	4.371,00	-1,2%	13,6%
BRL	5,18	-1,2%	2,0%
MXN	20,28	-0,6%	2,2%
JPY	134,27	-1,7%	22,6%
EUR	1,02	0,0%	-14,2%

Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	22,33	-3,9%	26,2%
MOVE	119,93	2,3%	93,2%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	32.530	1,0%	-7,3%
S&P	4.072	1,2%	-7,8%
FTSE	7.345	0,0%	3,8%
Nikkei	27.815	0,4%	0,1%
MEX	48.112	2,7%	-6,8%
Bovespa	102.597	1,1%	-18,4%
COLCAP	1.320	1,5%	6,0%

Indicadores de Riesgo

EMBI			
Indicador	27/07/2022	Variación diaria*	Variación Anual
EMBI G	465	0 Pb	135 Pb
EMBI G Colombia	418	-9 Pb	135 Pb
EMBI+	464	-3 Pb	90 Pb
EMBI+ Colombia	407	-9 Pb	114 Pb
EMBI+ Perú	179	-7 Pb	25 Pb
EMBI+ Brasil	329	-5 Pb	29 Pb
EMBI+ México	254	-2 Pb	37 Pb

* La variación diaria es con respecto al día anterior.

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	271	-11 Pb	122 Pb
CDS Perú	135	-6 Pb	42 Pb
CDS Brasil	281	-8 Pb	108 Pb
CDS México	162	-7 Pb	67 Pb
CDS Chile	133	-5 Pb	65 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.