

Noticias del día



La secretaria del Tesoro de EE.UU., Janet Yellen, volvió a advertir que el Gobierno está a punto de agotar su capacidad de endeudamiento, ahora fijada para el 18 de octubre. La fecha límite ha preocupado al mercado, ya que los rendimientos de la deuda a corto plazo se han visto afectados, el rendimiento del título a un mes se disparó hasta el 0,086%, el más alto desde el primer trimestre de 2021. Por otra parte, la presidenta del Banco de la Reserva Federal de San Francisco, Mary Daly, dijo que cree que el banco central estadounidense podrá empezar a reducir el ritmo de sus compras mensuales de activos a finales de año, pero cree que una subida de las tasas de interés está muy lejos. Finalmente, el presidente de la Fed, Jerome Powell, dijo que resolver la "tensión" entre la alta inflación y el aún elevado desempleo es el asunto más urgente que enfrenta la Reserva Federal en este momento.



En Europa, el gobernador del Banco de Inglaterra, Andrew Bailey, dijo que espera que la economía británica recupere su nivel de producción pre pandémico a principios del próximo año, un poco más tarde de lo que el banco central había previsto en agosto. En otras noticias, la banca europea solicitó 1.338,7 millones de euros de liquidez al Banco Central Europeo en la décima operación de refinanciación a largo plazo contra la pandemia, lo que supone un incremento del 157% en comparación con los fondos solicitados en la anterior subasta, celebrada en junio. Por otra parte, el primer ministro italiano y actual presidente del G20, Mario Draghi, se reunirá el jueves en Milán con la activista climática Greta Thunberg, con el fin de elaborar propuestas para hacer frente al calentamiento global.



En Colombia, el Ministerio de Hacienda y Crédito Público subastó por primera vez \$750.000 millones en TES Verdes denominados en pesos, con vencimiento a diez años, presentando una sólida demanda con ofertas de compra por \$2,3 billones, 4,61 veces el monto convocado inicialmente. En otras noticias, el director de la DIAN, Lisandro Junco, dio a conocer que, al 28 septiembre de 2021, el recaudo tributario del país llegó a los COP 130 billones, lo que muestra un aumento de COP 8 billones respecto al mismo periodo del año anterior. Por último, el Ministerio de Ambiente, radicó ante el Congreso de la República el proyecto “Ley de Acción Climática”, con medidas como la restauración ecológica de 962.000 hectáreas, reconversión de 3,6 millones de hectáreas a ganadería sostenible, alcanzar 600.000 vehículos eléctricos en circulación y declarar al menos 30% de los mares y áreas continentales como áreas protegidas.



El petróleo cayó después de que un informe del gobierno de EE.UU. mostrará que las reservas de crudo aumentaron por primera vez en ocho semanas, los futuros del petróleo West Texas Intermediate para entrega en noviembre cayeron 46 centavos y cerraron a 74,83 dólares el barril en Nueva York y el Brent para entrega en noviembre bajó 45 centavos y terminó la sesión a 78,64 dólares el barril. Por otra parte, los futuros del algodón para entrega en diciembre subieron un 4% a USD 1,04 la libra, su nivel más alto en casi una década, como consecuencia del mal clima que perjudicó los cultivos en todo el mundo y la incesante demanda de fibra de EE.UU., el principal exportador. Respecto a los metales, la plata al contado cayó 4,6% a USD 21,42 la onza, el nivel intradiario más bajo desde julio de 2020, la plata para entrega en diciembre cayó 4,4% para ubicarse en USD 21.485 en el Comex. El oro cayó un 0,6% después de haber subido hasta un 0,7%.

Tes Globales						
Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
21-mar-23	4.38%	COP 1,000	1.47	101.86	3.05%	2 Pb
28-jun-27	9.85%	COP 1,924	5.75	116.88	6.25%	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	1.46	101.35	1.69%	136 Pb	0 Pb	57 Pb	-1 Pb	
26-feb-24	4.000%	USD 1,566	2.41	104.51	2.07%	153 Pb	0 Pb	54 Pb	-16 Pb	
21-may-24	8.125%	USD 1,000	2.64	115.35	2.13%	167 Pb	0 Pb	58 Pb	-36 Pb	
28-ene-26	4.500%	USD 1,500	4.33	107.22	2.72%	184 Pb	3 Pb	56 Pb	-22 Pb	
25-abr-27	3.875%	USD 1,897	5.57	103.69	3.15%	207 Pb	3 Pb	68 Pb	-11 Pb	
15-mar-29	4.500%	USD 2,000	7.46	105.57	3.64%	228 Pb	3 Pb	68 Pb	-7 Pb	
30-ene-30	3.000%	USD 1,543	8.34	94.36	3.80%	238 Pb	5 Pb	84 Pb	16 Pb	
15-abr-31	3.125%	USD 2,540	9.54	93.69	3.92%	243 Pb	3 Pb	92 Pb	17 Pb	
22-abr-32	3.250%	USD 2,000	10.56	93.41	4.02%	247 Pb	0 Pb	N/A	N/A	
18-sep-37	7.375%	USD 1,818	15.97	123.00	5.23%	341 Pb	6 Pb	100 Pb	37 Pb	
18-ene-41	6.125%	USD 2,500	19.30	110.03	5.29%	330 Pb	3 Pb	103 Pb	43 Pb	
22-feb-42	4.125%	USD 1,000	20.40	89.89	4.92%	290 Pb	0 Pb	N/A	N/A	
26-feb-44	5.625%	USD 2,500	22.41	104.49	5.28%	325 Pb	4 Pb	107 Pb	48 Pb	
15-jun-45	5.000%	USD 4,500	23.71	97.59	5.18%	315 Pb	3 Pb	106 Pb	49 Pb	
15-may-49	5.200%	USD 1,800	27.63	99.90	5.21%	316 Pb	3 Pb	108 Pb	56 Pb	
15-may-51	4.125%	USD 1,500	29.63	86.26	5.02%	296 Pb	2 Pb	108 Pb	46 Pb	
15-feb-61	3.875%	USD 1,300	39.38	80.58	5.01%	295 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	4.48	110.55	1.42%	192 Pb	2 Pb	22 Pb	-38 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	0.13	0 Pb	-9 Pb
LIBOR 6 meses	0.16	0 Pb	-26 Pb
SOFR (overnight)	0.05	0 Pb	-2 Pb
Tesoros 2 años	0.29	-1 Pb	17 Pb
Tesoros 5 años	0.99	-3 Pb	74 Pb
Tesoros 10 años	1.52	-2 Pb	87 Pb
Tesoros 20 años	2.02	-2 Pb	83 Pb
Tesoros 30 años	2.06	-3 Pb	65 Pb

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad			
Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1,726.37	-0.4%	-9.0%
Petroleo WTI	74.83	-0.6%	90.5%
Petroleo BRENT	78.64	-0.6%	91.7%
Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3,839.00	0.1%	-1.2%
BRL	5.41	-0.3%	-3.9%
MXN	20.51	0.8%	-8.7%
JPY	111.96	0.4%	6.0%
EUR	1.16	-0.7%	-1.2%
Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	22.56	-3.0%	-14.1%
MOVE	61.21	-2.4%	67.1%

Renta Variable			
Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	34,391	0.3%	25.3%
S&P	4,359	0.2%	30.7%
FTSE	7,108	1.1%	20.5%
Nikkei	29,544	-2.1%	25.5%
MEX	51,085	0.3%	37.6%
Bovespa	111,107	0.9%	18.7%
COLCAP	1,360	0.7%	16.7%

Indicadores de Riesgo			
EMBI			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
EMBI G	321	-2 Pb	-84 Pb
EMBI G Colombia	299	1 Pb	30 Pb
EMBI+	369	-2 Pb	-51 Pb
EMBI+ Colombia	304	0 Pb	32 Pb
EMBI+ Perú	140	3 Pb	0 Pb
EMBI+ Brasil	320	-5 Pb	-33 Pb
EMBI+ México	214	-2 Pb	-73 Pb

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	164	2 Pb	9 Pb
CDS Perú	103	3 Pb	24 Pb
CDS Brasil	206	-1 Pb	-49 Pb
CDS México	102	0 Pb	-54 Pb
CDS Chile	89	1 Pb	19 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.