

Noticias del día



En Estados Unidos, la secretaria del Tesoro, Janet Yellen advirtió nuevamente que el impago de deuda estadounidense causaría un daño irreparable, así como una crisis financiera y una recesión posterior, por lo que asegura que es necesario aumentar el techo de la deuda de Estados Unidos. Por otra parte, el presidente del Banco de la Reserva Federal de Chicago, Charles Evans, dijo el jueves que cree que las perturbaciones de la oferta que están presionando al alza los precios disminuirán el año que viene y que seguirán siendo necesarias unas tasas de interés bajas para que la inflación estadounidense vuelva a ubicarse hasta el 2%. Finalmente, el presidente de la Reserva Federal de Atlanta, Raphael Bostic, dijo que acogía con satisfacción la revisión ética de la Junta de Gobernadores tras la renuncia de dos de sus colegas esta semana y consideró que el proceso de la Fed para sustituirlos es adecuado para garantizar un conjunto diverso de candidatos para los puestos de alto nivel.



Un proyecto de ley en Rusia busca aumentar el gasto del Estado en 5.200 millones de dólares en los próximos tres años modificando su sólida regla fiscal, y el proyecto pretende que los cambios sean permanentes para apoyar el crecimiento económico dada la baja inversión privada y extranjera que está sufriendo el país. En relación con bancos centrales, el Banco Nacional Checo (BNC) sorprendió al mercado con una subida de tasas de interés de 75 pb, su mayor incremento desde 1997, manifestando que vendrían más alzas para evitar que los ciudadanos y las empresas se acostumbren a que la inflación supere el objetivo del 2% del banco central. Por último, según una nota de la Comisión Europea, los ministros de Economía de la zona euro debatirán sobre el aumento de los precios de la energía dada su preocupación por la posibilidad de que frenen la recuperación económica, influyan en las decisiones de inversión y afecten de forma desproporcionada a los más pobres.



En Colombia, la Junta Directiva del Banco de la República, subió la tasa de interés en 25 puntos básicos hasta 2,0%, tras un año de mantenerla en su mínimo histórico de 1,75%. Cabe resaltar algunos de los elementos tomados en consideración fue el hecho que la actividad económica retomó su senda de recuperación, que en agosto la inflación anual continuó su tendencia al alza situándose en 4,4% y una ampliación del déficit en cuenta corriente. Por otra parte, según datos publicados por el DANE, para agosto de 2021, la tasa de desempleo fue de 12,33 % en comparación al 14,30 % de julio. Finalmente, el Ministerio de salud informó que a corte del 28 de septiembre se aplicaron 40,16 millones de vacunas contra el covid-19 dónde 23,35 millones de personas ya fueron vacunados con la primera dosis, 13,97 millones con la segunda dosis y 2,83 millones con la de Janssen.



El petróleo West Texas Intermediate para entrega en noviembre subió 20 centavos para ubicarse en USD 75,03 el barril. El Brent para entrega en noviembre cayó 12 centavos a USD 78,52 el barril. Respecto a los metales, el oro subió a su nivel más alto en una semana, ya que los inversionistas buscaron refugio después de que el informe laboral de Estados Unidos señalará una recuperación desigual en el mercado. Así las cosas, el oro al contado subió 2,2% a USD 1.764,26 la onza, el nivel intradía más alto desde el 23 de septiembre y los lingotes para entrega en diciembre subieron 2% para ubicarse en USD 1.757. La plata subió 2,7% a USD 22,12 la onza. Por otra parte, según informe de Rabobank, las exportaciones de arándanos alcanzarán casi 900.000 toneladas métricas para 2025-2026 a medida que los países de todo el mundo cultivan cada vez más la cosecha.

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	117.49	6.13%	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	101.39	1.66%	133 Pb	-4 Pb	54 Pb	-1 Pb
26-feb-24	4.000%	USD 1,566	2.41	104.52	2.07%	153 Pb	0 Pb	54 Pb	-12 Pb
21-may-24	8.125%	USD 1,000	2.64	115.40	2.10%	165 Pb	-2 Pb	55 Pb	-31 Pb
28-ene-26	4.500%	USD 1,500	4.33	107.19	2.73%	186 Pb	2 Pb	58 Pb	-12 Pb
25-abr-27	3.875%	USD 1,897	5.57	103.67	3.15%	210 Pb	3 Pb	71 Pb	-1 Pb
15-mar-29	4.500%	USD 2,000	7.46	105.53	3.65%	232 Pb	4 Pb	72 Pb	3 Pb
30-ene-30	3.000%	USD 1,543	8.33	94.36	3.79%	242 Pb	3 Pb	87 Pb	26 Pb
15-abr-31	3.125%	USD 2,540	9.54	93.66	3.93%	246 Pb	3 Pb	95 Pb	28 Pb
22-abr-32	3.250%	USD 2,000	10.56	93.44	4.02%	250 Pb	3 Pb	N/A	N/A
18-sep-37	7.375%	USD 1,818	15.97	122.87	5.24%	345 Pb	4 Pb	103 Pb	47 Pb
18-ene-41	6.125%	USD 2,500	19.30	110.02	5.29%	333 Pb	2 Pb	106 Pb	52 Pb
22-feb-42	4.125%	USD 1,000	20.39	89.99	4.91%	291 Pb	1 Pb	N/A	N/A
26-feb-44	5.625%	USD 2,500	22.41	104.40	5.29%	328 Pb	3 Pb	110 Pb	57 Pb
15-jun-45	5.000%	USD 4,500	23.71	97.56	5.18%	317 Pb	2 Pb	109 Pb	57 Pb
15-may-49	5.200%	USD 1,800	27.63	99.78	5.21%	318 Pb	3 Pb	111 Pb	63 Pb
15-may-51	4.125%	USD 1,500	29.63	86.31	5.02%	297 Pb	1 Pb	109 Pb	53 Pb
15-feb-61	3.875%	USD 1,300	39.38	80.93	4.99%	294 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	110.51	1.43%	192 Pb	2 Pb	22 Pb	-37 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	-10 Pb
LIBOR 6 meses	0.16	0 Pb	-26 Pb
SOFR (overnight)	0.05	0 Pb	-3 Pb
Tesoros 2 años	0.28	-1 Pb	15 Pb
Tesoros 5 años	0.97	-2 Pb	69 Pb
Tesoros 10 años	1.49	-3 Pb	80 Pb
Tesoros 20 años	1.99	-2 Pb	77 Pb
Tesoros 30 años	2.05	-2 Pb	59 Pb

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	1,756.95	1.8%	-6.8%
Petroleo WTI	75.03	0.3%	86.5%
Petroleo BRENT	78.52	-0.2%	91.7%
Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3,807.80	-0.8%	-0.5%
BRL	5.44	0.5%	-3.0%
MXN	20.64	0.6%	-6.7%
JPY	111.29	-0.6%	5.5%
EUR	1.16	-0.2%	-1.2%
Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	23.14	2.6%	-12.2%
MOVE	61.07	-0.2%	55.8%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	33,844	-1.6%	21.8%
S&P	4,308	-1.2%	28.1%
FTSE	7,086	-0.3%	20.8%
Nikkei	29,453	-0.3%	27.0%
MEX	51,386	0.6%	37.2%
Bovespa	110,979	-0.1%	17.3%
COLCAP	1,362	0.1%	16.2%

Indicadores de Riesgo

EMBI			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
EMBI G	324	3 Pb	-74 Pb
EMBI G Colombia	301	2 Pb	39 Pb
EMBI+	373	4 Pb	-39 Pb
EMBI+ Colombia	306	2 Pb	40 Pb
EMBI+ Perú	148	8 Pb	13 Pb
EMBI+ Brasil	327	7 Pb	-16 Pb
EMBI+ México	218	4 Pb	-61 Pb

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	169	5 Pb	17 Pb
CDS Perú	106	2 Pb	28 Pb
CDS Brasil	206	0 Pb	-44 Pb
CDS México	102	0 Pb	-50 Pb
CDS Chile	88	0 Pb	20 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.