

Informe Diario DE MERCADO

Septiembre 22 de 2023

PESO COLOMBIANO

Ayer el USDCOP abrió en \$3.940, con un gap bajista de \$39 respecto al cierre anterior (\$3.901). Durante la jornada el par operó entre \$3.929 y \$3.965,90, cerrando muy cerca del nivel de apertura en \$3.939, con una variación diaria de 0,97%. El volumen de negociación fue de \$US 0,94B, por debajo del promedio año corrido (\$US 1,17B). En la jornada de hoy, el USDCOP podría operar entre \$3.900 y \$3.950.

DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF se desvalorizó 3pbs ayer con relación al 19 de septiembre, siguiendo el comportamiento de los tesoros americanos tras conocerse la decisión de la Fed. Por su parte, los TES UVR presentaron un comportamiento mixto, con valorizaciones en los nodos 2029 (-2pbs), 2025 (-1pbs) y 2037 (-3pbs), mientras que los demás nodos presentaron desvalorizaciones.

ESTADOS UNIDOS

Las solicitudes de desempleo semanales disminuyeron 20K hasta 201K en la semana 10 al 16 de septiembre desde lo registrado la semana anterior (221K) y por debajo de lo esperado por el mercado (225K), alcanzando niveles no vistos desde enero del 2023. Estos resultados siguen mostrando un mercado laboral resiliente, lo que sugiere que las presiones inflacionarias se mantendrán por más tiempo. Cabe mencionar que ante la huelga parcial del sindicato United Auto Workers (UAW) se espera que estas peticiones aumenten en las próximas semanas, dado que las afectaciones en las cadenas de suministros, generan una disminución en la producción y por ende menos demanda laboral, aumentando los despidos temporales.

ZONA EURO

El PMI Compuesto aumentó 0,4pts hasta los 47,1pts en septiembre, desde los 46,7pts alcanzados en agosto, por encima de lo esperado por el mercado (47,7pts), pero en zona de contracción (<50pts) por cuarto mes consecutivo. Este leve repunte se da por el sector de servicios que a pesar de su ralentización continúa jalando la economía y compensando la moderación más fuerte del sector manufacturero. Ante estos resultados, el mercado aumentó sus expectativas de una posible contracción en la dinámica económica para 3T2023. Cabe mencionar, que Alemania, el motor económico del bloque, muestra signos más profundos de debilitamiento, especialmente en el sector manufacturero a causa de la débil demanda y los altos costos.

REINO UNIDO

El PMI Compuesto disminuyó hasta 46,8pts en septiembre, por debajo de lo observado el mes anterior (48,6pts) y de lo esperado por el mercado (48,7pts), alcanzando su nivel más bajo desde enero de 2021. Esta disminución se debió a la moderación del sector servicios y la continua contracción del sector manufacturero. Con estos resultados se observa que la actividad económica se ha mantenido en terreno contractivo (<50pts) desde julio de este año, lo que podría dar indicios de que durante el 3T2023 la economía se contraiga.

JAPÓN

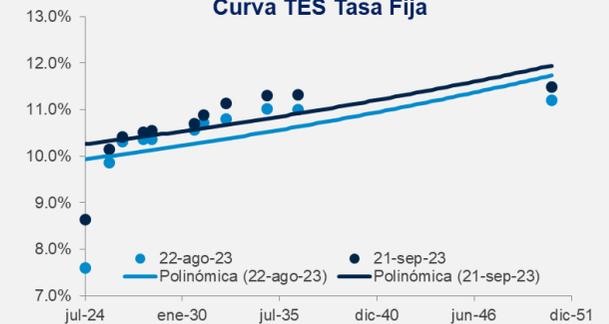
El Banco Central de Japón (BoJ) decidió mantener la tasa de interés en -0,10%. En el comunicado se aprecia que esta decisión estuvo basada en la alta incertidumbre que hay en torno a las perspectivas económicas a nivel nacional y mundial. Adicionalmente, el Gobernador de la entidad aseguró que cuando puedan tener certeza de que la inflación se mantendrá en 2%, evaluarían su política monetaria expansiva.

SIN DATOS A MONITOREAR

Cotización Tasa Peso - Dólar



Curva TES Tasa Fija



DEVALUACIONES FWD



K:miles, M:millones, MM:Miles de millones, B:billones, T:trillones, pbs: puntos básicos, pps: puntos porcentuales, a/a: anual, t/t: trimestral, m/m mensual, esp: esperado, ant: anterior
COP: Peso colombiano bpd: barriles por día.

Informe Diario de Mercado

INDICADORES

DÓLAR	TRM	MÁXIMO	MÍNIMO	CIERRE
AYER	\$ 3,907.21	\$ 3,965.90	\$ 3,929.00	\$ 3,939.00
HOY	\$ 3,948.25	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 3,960.27	\$ 3,981.53	\$ 4,018.43
Soportes	\$ 3,923.37	\$ 3,907.73	\$ 3,870.83

NIVELES TÉCNICOS - EUR / USD			
Resistencias	€ 1.0684	€ 1.0708	€ 1.0765
Soportes	€ 1.0627	€ 1.0594	€ 1.0537

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	1.0649	-0.11%
GBPUSD	1.2260	-0.31%
USDCHF	0.9060	-0.17%
USDCAD	1.3449	0.25%
USDJPY	148.3400	-0.51%
AUDUSD	0.6459	0.67%
USDMXN	17.1372	0.56%
USDBRL	4.9260	0.18%
USDCLP	887.5600	0.11%

TIPOS DE INTERÉS DE LOS BANCOS CENTRALES		
Banco Central	Tasa de interés	Próxima reunión
JDBR	13.25%	29-sep-23
FED	5.25% - 5.50%	1-nov-23
ECB	4.50%	26-oct-23
BOE	5.25%	2-nov-23
BOJ	-0.10%	31-oct-23
BOC	5.00%	25-oct-23

MERCADO MONETARIO		
Cupo 3 días (Cifras en miles de millones de COP)	1 día	\$ 14,972.76
	Plazo	Limitado
Demanda		14,356.61
% Cupo aprobado		95.88%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	
8.7350	

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU**	34,361.00	0.07%
SPX**	4,386.25	0.33%
CCMP**	14,952.00	0.60%
COLCAP	1,082.38	-1.20%
INMEX	3,212.49	-1.02%
IBOV	116,929.65	0.68%
UKX	7,713.46	0.45%
CAC	7,182.59	-0.43%
NKY	32,402.41	-0.52%

** Futuros

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Variación diaria
IBR Overnight TN	12.323%	0.13%
IBR 1 mes TN	12.318%	-0.06%
IBR 3 meses TN	12.335%	0.26%
DTF EA	13.08%	0.00%
DTF TA	12.11%	0.00%
TRM	3948.25	1.05%
Petróleo BRENT	94.30	1.07%
Indicador	ago-23	ago-22
IPC-anual EA	11.43%	10.84%
IPC-mensual EA	0.70%	1.02%

Hora de actualización: 8:35 a.m.

CALENDARIO ECONÓMICO

FIN DE SEMANA/LUNES

ISE			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	1.18%	-	1.72%

MARTES

Importaciones (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-28.20%	-	-21.20%

Decisión de tasa preferencial			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	4.20%	4.20%	4.20%

MIÉRCOLES

Inflación (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	6.70%	7.00%	6.80%

Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	5.50%	5.50%	5.50%

Actualización proyecciones Fed			
--------------------------------	--	--	--

Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	12.75%	12.75%	13.25%

JUEVES

Decisión de tipos interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	5.25%	5.50%	5.25%

Confianza del Consumidor			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-17.80	-16.80	-16.00

Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-0.10%	-0.10%	-0.10%

VIERNES

PMI Compuesto			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	46.20	44.80	44.60

PMI Compuesto			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	47.10	46.50	46.70

PMI Compuesto			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	46.80	48.70	48.60

PMI Compuesto			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	50.10	-	50.20

Impacto: ● Alto ● Medio ● Bajo

Nuestro Equipo:

Luis Fernando Insignares

Subgerente de Mesa de Distribución
e Investigaciones Económicas

Santiago Echavarría

Especialista
Investigaciones Económicas

María Paula Campos

Analista Profesional
Investigaciones Económicas

Diana Fernanda Quiroga

Analista Junior

Esta publicación fue realizada por la Tesorería del Banco de Occidente. La información no deberá interpretarse como una asesoría, recomendación o sugerencia de parte nuestra para la toma de decisiones, razón por la cual el uso de la información suministrada es de exclusiva responsabilidad del usuario.