

Informe Diario DE MERCADO

Septiembre 27 de 2023

PESO COLOMBIANO

Ayer el USDCOP abrió en \$4.041, con un gap bajista de \$12 respecto al cierre anterior (\$4.053), siendo este el mínimo de la jornada (\$4.041). Al iniciar la sesión, el par fue presionado al alza y llegó al máximo de \$4.088, posteriormente presentó un comportamiento lateral y cerró en \$4.070,80, con una variación diaria de 0.44%. El volumen de negociación fue de \$US 1,05B, por debajo del promedio año corrido (\$US 1,17B). En la jornada de hoy, el USDCOP podría operar entre \$4.050 y \$4.100.

DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF se desvalorizó 22pbs ayer con relación al 25 de septiembre, siguiendo el comportamiento de la renta fija internacional. En esta línea, los TES UVR se desvalorizaron 13pbs, ante la venta de inversionistas extranjeros en la parte corta y media de la curva.

COLOMBIA

El Índice de Confianza Comercial cayó 9,3pps en agosto hasta 12,4% respecto a julio. Esto se explicó por la caída en 17,1pps de las expectativas de la situación económica para el próximo semestre, así como la caída en 4,1pps de la situación actual de las empresas. Por su parte, el Índice de Confianza Industrial aumentó 3,9pps hasta 3,7%, explicado principalmente por el aumento en 6,6pps en las expectativas de producción para el próximo trimestre y el aumento de 3,4pps en el volumen actual de pedidos. Adicionalmente, la utilización de capacidad instalada de la industrial aumentó 2,1pps hasta 76%, así mismo, mejoró la percepción de las empresas sobre las condiciones económicas y la percepción de condiciones sociopolíticas para invertir.

ESTADOS UNIDOS

Las ventas de viviendas nuevas disminuyeron 8,7% a/a en agosto, una caída mayor a la esperada por el mercado (2,2% a/a). De acuerdo

con el Departamento de Comercio, en agosto se vendieron 675K viviendas nuevas, menos de las observadas en julio (739K). La adquisición de viviendas nuevas estaría explicada principalmente por la escasez de oferta de viviendas usadas, aunque su moderación evidencia las dificultades de los compradores ante el aumento de las tasas hipotecarias a niveles no vistos desde el año 2000. Cabe recordar que la semana pasada se conoció que en agosto las ventas de viviendas usadas se redujeron al nivel más bajo en siete meses (4,04M).

De acuerdo con The Conference Board, el Índice de Confianza de los Consumidores cayó 5,7pts en septiembre hasta 103pts, desde los 108,7pts registrados en agosto y por debajo de lo esperado por el mercado (105,5pts), completando tres meses consecutivos de caída. Este comportamiento se explica principalmente por la caída del Índice de Expectativas (basado en perspectivas de corto plazo en cuanto a ingresos, negocios y condiciones del mercado laboral) que disminuyó 9,6pts hasta 73,7pts en septiembre, por debajo de los 80pts. Por otro lado, compensando la caída, el Índice de Situación Actual (evaluación de los consumidores sobre condiciones empresariales y de mercado laboral actuales) aumentó ligeramente 0,4pts hasta 147,1pts.

ALEMANIA

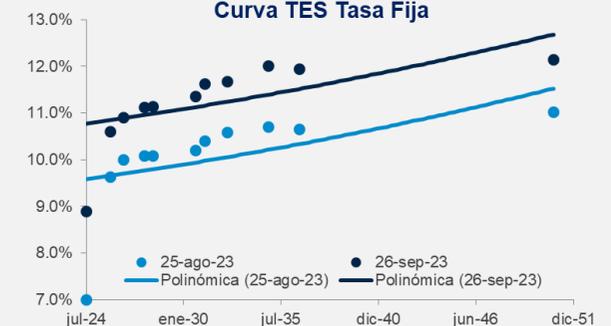
El índice Gfk de clima de consumo cayó 1,1pts hasta -26,5pts en el dato preliminar para el mes de octubre, menor al registrado en septiembre (-25,6pts), y peor de lo esperado por el mercado (-26,0pts). Este aumento en la desconfianza por parte de los consumidores se debe principalmente a menores expectativas en los ingresos, presionado por la pérdida del poder adquisitivo ante los altos precios de los alimentos y la energía, haciendo que su consumo se limite a lo esencial, aumentando la propensión al ahorro y disminuyendo la propensión a comprar.

SIN DATOS A MONITOREAR

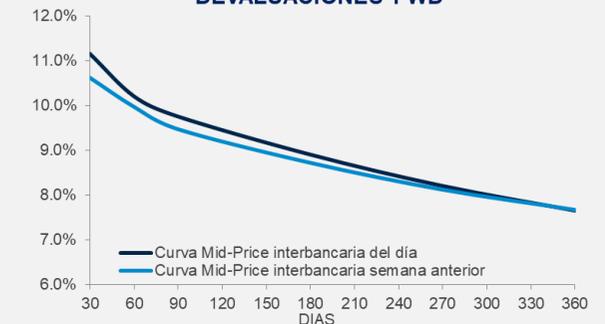
Cotización Tasa Peso - Dólar



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	\$ 4,052.54	\$ 4,088.00	\$ 4,041.00	\$ 4,070.80
HOY	\$ 4,068.73	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4,092.20	\$ 4,113.60	\$ 4,160.60
Soportes	\$ 4,045.20	\$ 4,019.60	\$ 3,972.60

NIVELES TÉCNICOS - EUR / USD			
Resistencias	€ 1.0600	€ 1.0628	€ 1.0675
Soportes	€ 1.0553	€ 1.0534	€ 1.0487

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	1.0542	-0.28%
GBPUSD	1.2143	-0.12%
USDCHF	0.9184	-0.28%
USDCAD	1.3526	-0.07%
USDJPY	149.2100	-0.09%
AUDUSD	0.6369	-0.44%
USDMXN	17.6344	-0.49%
USDBRL	5.0151	-0.49%
USDCLP	902.8000	0.12%

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	\$ 18,871.74
	Plazo	Limitado
Demanda		9,145.13
% Cupo aprobado		48.46%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)

Cierre jornada anterior	8.7284
-------------------------	--------

ÍNDICES BURSÁTILES

Índice	Valor	Variación diaria
INDU**	33,976.00	0.30%
SPX**	4,330.00	0.35%
CCMP**	14,763.00	0.33%
COLCAP	1,089.57	-0.98%
INMEX	3,165.93	-0.50%
IBOV	114,193.43	0.00%
UKX	7,616.89	-0.12%
CAC	7,073.49	-0.01%
NKY	32,371.90	0.18%

** Futuros

INDICADORES ECONÓMICOS

Indicador	Valor	Variación diaria
IBR Overnight TN	12.263%	-0.02%
IBR 1 mes TN	12.305%	-0.11%
IBR 3 meses TN	12.325%	0.04%
DTF EA	13.01%	0.00%
DTF TA	12.05%	0.00%
TRM	4068.73	0.40%
Petróleo BRENT	95.52	1.66%
Indicador	ago-23	ago-22
IPC-anual EA	11.43%	10.84%
IPC-mensual EA	0.70%	1.02%

Hora de actualización: 7:29 a.m.

▶ CALENDARIO
ECONÓMICO

Calendario Sep 25 - Sep 29

FIN DE SEMANA/LUNES

Confianza Empresarial Ifo			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	85.70	85.20	85.80

Comparecencia Kashkari, miembro Fed	

MARTES

Confianza del Consumidor CB			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	103.0	105.5	108.7

Comparecencia Bowman, miembro Fed	

MIÉRCOLES

Confianza del Consumidor Gfk			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-24.2	-24.8	-25.2

JUEVES

Inflación (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	4.60%	6.10%

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

Solicitudes de desempleo			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-	201K

Comparecencia Powell, presidente de la Fed	

VIERNES

Inflación (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●		4.80%	5.30%

Inflación PCE (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●		3.50%	3.30%

Tasa de desempleo			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-	9.6%

Decisión de tipos interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	13.25%	13.25%

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.