

Informe Diario DE MERCADO

Septiembre 28 de 2023

PESO COLOMBIANO

Ayer el USDCOP abrió en \$4.075. Al comenzar la jornada el par llegó al mínimo de \$4.060, posteriormente fue presionado al alza hasta \$4.132,50, cerrando en \$4.119,10, con una variación diaria de 1.19%. El volumen de negociación fue de \$US 0,95B, por debajo del promedio año corrido (\$US 1,16B). En la jornada de hoy, el USDCOP podría operar entre \$4.075 y \$4.130.

DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF se desvalorizó 26pbs ayer con relación al 26 de septiembre, siguiendo el comportamiento de los tesoros americanos (+3pbs), donde particularmente, la referencia a 10 años alcanzó su mayor tasa de rendimiento en 15 años (sube en tasa y cae en precio). En esta línea, los TES UVR se desvalorizaron 14pbs.

ESTADOS UNIDOS

El precio del petróleo WTI (referencia de crudo para Estados Unidos) aumentó hasta los \$US95,03 pb, alcanzando su nivel más alto desde agosto del 2022. Esto se debió a que los inventarios en Cushing, Oklahoma cayeron a 2,2M de barriles esta semana, cerca del mínimo operativo, lo que significa una caída de 943K barriles respecto a la semana anterior. Estos inventarios han disminuido en las últimas semanas debido al aumento de demanda para refinado y exportación, presionando los precios al alza. De continuar cayendo los inventarios de este almacenamiento clave en el país y de mantenerse los recortes de producción de Arabia Saudita y Rusia, el precio de la referencia de crudo podría continuar aumentando. Cabe mencionar que esta referencia ha aumentado 32% desde julio de este año y 8,74% solo en septiembre.

Durante la jornada de ayer, el presidente de la FED de Minneapolis, Neel Kashkari, explicó que, el cierre del Gobierno estadounidense o la huelga

de trabajadores de las fábricas de automóviles podrían generar una ralentización en la dinámica económica, lo que podría llevar a la FED a detener los movimientos al alza de la tasa de interés. Sin embargo, aclaró que no espera que este escenario ocurra. Jerome Powell, presidente de la Reserva Federal, dará un discurso a las 3:00 pm, los inversores estarán atentos a sus comentarios sobre política monetaria, inflación y economía.

CHINA

La negociación de las acciones de Evergrande se suspendió en la madrugada del jueves 28 de septiembre, tras conocer que su presidente, Hui Ka Yan, fue arrestado por la policía, aunque no es claro el motivo de este proceso policial, el suceso ha interrumpido la reestructuración de la deuda extraterritorial de esta empresa, aumentando los riesgos de liquidación. Cabe mencionar, que esto ha planteado la posibilidad de una intervención de las autoridades chinas para gestionar cualquier impacto en el sistema financiero y la economía en general. De esta manera, las bolsas bursátiles de Asia presentan algunas pérdidas durante la jornada del 28 de septiembre, particularmente el Hang Seng cae 1.36%, y el Nikkei cae 1.54%.

ALEMANIA

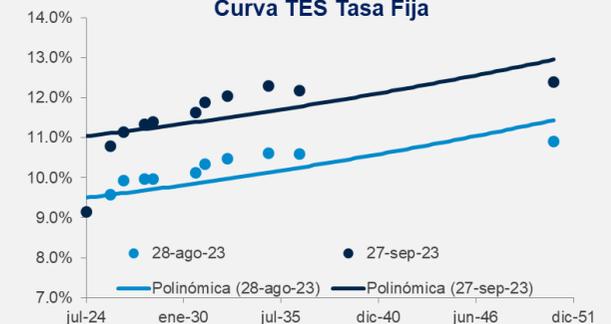
Según Destatis, el dato preliminar del Índice de Precios al Consumidor (IPC) para septiembre aumentó 0,3% m/m, con la misma variación de agosto (0,3% m/m). Llevando a una variación anual de 4,5% en septiembre, por debajo de lo registrado en agosto (6,1% a/a) y de lo esperado por el mercado (4,6% a/a), alcanzando niveles no vistos desde febrero de 2022. Esta caída en el ritmo de crecimiento de los precios se dio principalmente por la disminución de los precios de la energía, beneficiados por el paquete de ayuda del gobierno federal y el efecto base respecto a septiembre del 2022. Sin embargo, los alimentos continúan mostrando presiones al alza.

Datos a Monitorear		
Indicador	País	Hora
Comparecencia Powell, presidente de la Fed		3:00 p.m.

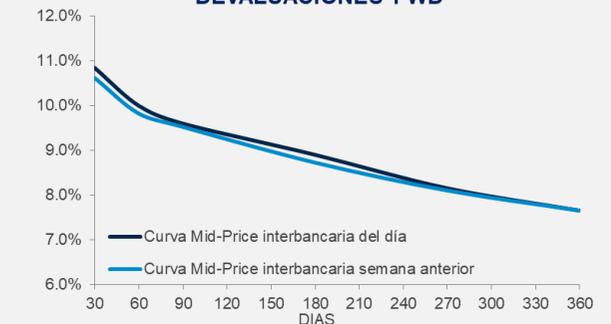
Cotización Tasa Peso - Dólar



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	\$ 4,068.73	\$ 4,132.50	\$ 4,060.00	\$ 4,119.10
HOY	\$ 4,093.60	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4,147.73	\$ 4,176.37	\$ 4,248.87
Soportes	\$ 4,075.23	\$ 4,031.37	\$ 3,958.87

NIVELES TÉCNICOS – EUR / USD			
Resistencias	€ 1.0555	€ 1.0608	€ 1.0694
Soportes	€ 1.0469	€ 1.0436	€ 1.0350

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	1.0531	0.27%
GBPUSD	1.2185	0.41%
USDCHF	0.9189	0.26%
USDCAD	1.3502	-0.03%
USDJPY	149.4700	0.11%
AUDUSD	0.6386	0.52%
USDMXN	17.6763	-0.03%
USDBRL	5.0455	-0.03%
USDCLP	907.4700	0.36%

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	\$ 18,074.10
	Plazo	Limitado
Demanda		15,040.51
% Cupo aprobado		83.22%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	9.1500

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU	33,550.27	-0.20%
SPX	4,274.51	0.02%
CCMP	13,092.85	0.22%
COLCAP	1,107.59	1.65%
INMEX	3,184.62	0.59%
IBOV	114,327.05	0.12%
UKX	7,574.77	-0.24%
CAC	7,105.15	0.47%
NKY	31,872.52	-1.54%

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Variación diaria
IBR Overnight TN	12.291%	0.23%
IBR 1 mes TN	12.320%	0.12%
IBR 3 meses TN	12.310%	-0.12%
DTF EA	13.01%	0.00%
DTF TA	12.05%	0.00%
TRM	4093.60	0.61%
Petróleo BRENT	96.05	-0.52%
Indicador	ago-23	ago-22
IPC-anual EA	11.43%	10.84%
IPC-mensual EA	0.70%	1.02%

Hora de actualización: 7:50 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.
●	4.10%	5.90%	6.10%

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

Solicitudes de desempleo			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	204K	215K	202K

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 Echavarria
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.