

Informe Diario DE MERCADO

Septiembre 30 de 2022

PESO COLOMBIANO

Ayer USDCOP abrió en el mínimo de la jornada de \$4.499, posteriormente fue presionado al alza hasta \$4.548,5 y cerró en \$4.428,69, con una variación diaria de 0,86%. El volumen de negociación fue \$US 1,53B, por encima del promedio año corrido (\$US 1,16B). Para la jornada de hoy el USDCOP podría operar entre \$4.525 y \$4.575.

DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF se desvalorizó ayer 3pbs con excepción de los TES TF 2050 (-1pbs), debido a la expectativa de la decisión del BanRep y la aversión al riesgo internacional. En esta línea, los TES UVR se desvalorizaron 4pbs en promedio.

COLOMBIA

En su reunión de septiembre, la Junta Directiva del Banco de la República (JDBR) aumentó la tasa de interés en 100pbs hasta 10%, por debajo de lo esperado por el mercado (150pbs), alcanzando la tasa más alta desde julio de 2008. La decisión fue tomada por mayoría, donde 6 miembros estuvieron a favor y el miembro restante consideró oportuno elevar la tasa de interés en tan solo 50pbs. El Gerente del Banco argumentó que el incremento de tasas obedeció al repunte de la inflación, así como las expectativas de corto y mediano plazo y el dinamismo de la economía local.

ESTADOS UNIDOS

La inflación PCE, que evalúa el comportamiento de los precios a partir del gasto de los consumidores, subió 6,2% a/a en agosto, por debajo del dato registrado en julio (6,4% a/a). Por su parte, la inflación PCE básica, que excluye los componentes volátiles como los alimentos y la energía,

subió 4,9% a/a, por encima de lo observado en julio (4,7% a/a). Por otro lado, los ingresos personales aumentaron 0,4% m/m, por encima de las expectativas del mercado (0,2% m/m). Lo anterior evidencia la persistencia de las presiones inflacionarias y la solidez del consumo interno de los hogares, lo que llevaría a que la Reserva Federal continúe aumentando la tasa de referencia.

ZONA EURO

El índice de Precios al Consumidor (IPC) aumento 10,0% a/a en septiembre, por encima de lo esperado por el mercado (9,7% a/a) y del dato observado de agosto (9,1% a/a), alcanzando el máximo histórico. Esto se debió a los mayores precios de la energía (+40,8% a/a) a causa de las tensiones geopolíticas con Rusia y Ucrania, y los alimentos (+11,8% a/a). Los países con mayor inflación fueron Estonia (24% a/a) y Lituania (22% a/a), y la menor fue en Francia (6,2% a/a) y Malta (7,3% a/a).

MÉXICO

El Banco de México (Banxico) aumentó la tasa de interés en 75pbs desde 8,5% observado en agosto hasta 9,25%, esta decisión fue por unanimidad y es el cuarto aumento consecutivo por esta magnitud (75pbs). El comité de política monetaria tuvo en cuenta las siguientes elementos: i) alta inflación global debido a los desbalances entre demanda y oferta, ii) postura agresiva de los principales bancos centrales (FED, BCE y BoE), iii) desaceleración de la actividad económica mundial y iv) aumento de 50pbs en la expectativa de inflación para cierre del 2022 al 8,5%.

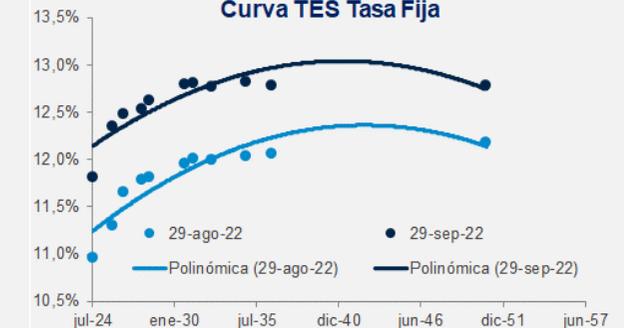
Datos a Monitorear

Indicador	País	Esp.	Ant.	Hora
Tasa desempleo nacional		-	11,00%	10:00 AM

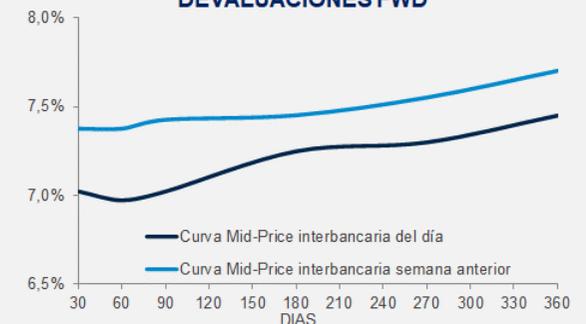
Cotización Tasa Peso - Dólar



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	\$ 4.486,94	\$ 4.548,50	\$ 4.499,00	\$ 4.528,69
HOY	\$ 4.532,07	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4.551,79	\$ 4.574,90	\$ 4.624,40
Soportes	\$ 4.502,29	\$ 4.475,90	\$ 4.426,40

NIVELES TÉCNICOS – EUR / USD			
Resistencias	€ 0,9875	€ 0,9936	€ 1,0117
Soportes	€ 0,9694	€ 0,9574	€ 0,9393

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	0.9754	-0,62%
GBPUSD	1,1094	-0,21%
USDCHF	0.9803	0,48%
USDCAD	1,3734	0,39%
USDJPY	144,5800	0,08%
AUDUSD	0.6474	-0,40%
USDMXN	20,1235	-0,22%
USDBRL	5,4143	0,25%
USDCLP	960,0000	-0,52%

TIPOS DE INTERÉS DE LOS BANCOS CENTRALES		
Banco Central	Tasa de interés	Próxima reunión
JDBR	10,00%	28/10/2022
FED	3,00%-3,25%	02/11/2022
ECB	1,25%	27/10/2022
BOE	2,25%	03/11/2022
BOJ	-0,10%	28/10/2022
BOC	3,25%	26/10/2022

MERCADO MONETARIO		
Cupo 3 días (Cifras en miles de millones de COP)	1 día	\$ 21.292,00
	Plazo	Limitado
Demanda		18.235,00
% Cupo aprobado		85,64%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	11,8012

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU	29,101.54	-0,42%
SPX	3,622.32	-0,50%
CCMP	10,739.96	0,02%
COLCAP	1.137,58	0,16%
INMEX	2.788,82	0,11%
IBOV	107.851,14	0,17%
UKX	6,866.49	-0,22%
CAC	5,722.09	0,80%
NKY	25,937.21	-1,84%

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Var cor. año
IBR Overnight TN	9,015%	6,11%
IBR 1 mes TN	10,349%	7,38%
IBR 3 meses TN	11,038%	7,62%
DTF EA	10,90%	7,68%
DTF TA	10,21%	7,06%
TRM	4532,07	13,84%
DEV(cor. año)EA	13,84%	25,99%
Petróleo BRENT	93,86	20,33%
Indicador	ago-21	ago-22
IPC-mensual EA	0,45%	1,02%
IPC-anual EA	4,44%	10,84%

Informe Diario de Mercado

▶ CALENDARIO ECONÓMICO

FIN DE SEMANA/LUNES

Calendario Sep 26 - Sep 30

PMI Manufacturero (P)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	51,0	-	51,5

Confianza empresarial IFO			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	84,3	87,0	88,6

MARTES

Confianza del consumidor			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	108,00	104,00	103,20

Ventas viviendas nuevas			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	28,8%	-	-8,6%

MIÉRCOLES

Índice de Consumo GFK			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-42,50	-39,00	-36,50

Inventarios de crudo AIE			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-0,215M	-0,443M	1,142M

JUEVES

IPC (a/a) (p)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	10,00%	9,80%	7,90%

Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	9,25%	9,25%	8,50%

PMI Manufacturero Markit			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	48,10	49,50	49,50

Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	10,00%	10,50%	9,00%

VIERNES

IPC (a/a) (p)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	10,00%	9,60%	9,10%

Inflación PCE (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	6,20%	-	6,40%

Tasa desempleo nacional			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-	11,00%

Impacto: ● Alto ● Medio ● Bajo

Nuestro Equipo:

Angie Natalia Roa

Analista Senior Investigaciones Económicas

María Paula Campos

Analista de Investigaciones Económicas

Daniel Alejandro Echeverri

Analista de Investigaciones Económicas

Luis Fernando Insignares

Subgerente de Mesas de Distribución

Carlos Albán Correa

Director Mesa de Distribución

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.