

# Informe Diario DE MERCADO

## Septiembre 28 de 2022

### PESO COLOMBIANO

Ayer USDCOP abrió en \$4.525, con un gap bajista de \$16,6 frente al cierre anterior (\$4.541,6). Al comenzar la jornada el par llegó al mínimo de \$4.517, posteriormente fue presionado al alza hasta el máximo de \$4.576 y cerró en \$4.554, con una variación diaria de 0,27%. El volumen de negociación fue \$US 843M, por debajo del promedio año corrido (\$US 1,16B). Para la jornada de hoy el USDCOP podría operar entre \$4.480 y \$4.530.

### DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF presentó un comportamiento mixto ayer, con valorizaciones en los TES TF 2024 (-9pbs) y TES TF 2025 (-5pbs) y desvalorizaciones en los TES TF 2028 (+3pbs), TES TF 2030 (+6pbs) y TES TF 2032 (+4pbs). Por su parte, los TES UVR se valorizaron 3pbs.

### ESTADOS UNIDOS

La confianza al consumidor del Conference Board subió 4,4pts en septiembre desde 103,6pts registrado en agosto hasta 108,0pts, por encima de lo esperado por el mercado (104,5pts) y aumentando por segundo mes consecutivo. Este optimismo obedeció a los resultados del mercado laboral y la caída en los precios de la gasolina.

La tasa de interés promedio de préstamo hipotecario a 30 años aumentó 27pbs hasta 6,52% para la semana del 23 de septiembre, el nivel más alto desde la crisis financiera del 2008. Este incremento obedeció a la sensibilidad del sector al incremento de tasas de interés de la FED.

### REINO UNIDO

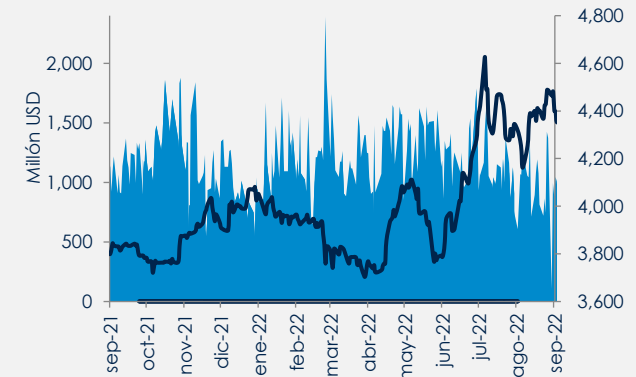
El Banco de Inglaterra (BoE) anunció la compra de bonos de deuda pública gilt de largo plazo desde el 28 de septiembre hasta el 14 de octubre, con el fin de reestablecer el orden en el mercado y evitar un endurecimiento de las condiciones financieras. Esto se da luego de que los rendimientos de los gilts alcanzaran el nivel más alto desde 1957 de 5,14% y 4,60% en las referencias de 30 y 10 años respectivamente, como consecuencia del anuncio de reducción de impuestos del gobierno. Con lo anterior, queda suspendido el plan de venta de bonos gilt de \$US 85MM anuales y se espera que reanude el 31 de octubre.

### INTERNACIONAL

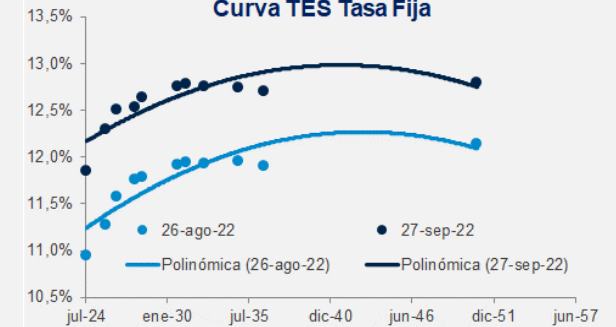
Dinamarca y Suecia advirtieron sobre 3 fugas que tendría el gasoducto Nord Stream 1 y 2 en el mar báltico, cerca de la Isla danesa Bornholm. Ambos gobiernos consideran que las fugas fueron causadas por acciones deliberadas tras detectar explosiones en los registros sísmicos. Lo anterior representa un impacto adicional a la crisis energética y una afectación ambiental en la zona. Se destaca que el Nord Stream 1 estaba operando a una capacidad reducida (20%) desde mediados de junio, reportó una caída de presión. Por su parte, el gobierno de Rusia negó haber ocasionado estas fugas con el fin de profundizar la crisis energética en Europa. Ante la noticia el gas natural alcanzó a valorizarse 28,09% en la jornada del 27 de septiembre.

### SIN DATOS A MONITOREAR

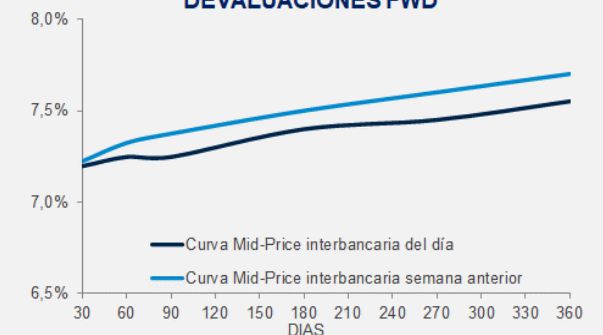
#### Cotización Tasa Peso - Dólar



#### 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	\$ 4.496,99	\$ 4.576,00	\$ 4.517,00	\$ 4.554,00
HOY	\$ 4.556,42	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4.581,00	\$ 4.608,00	\$ 4.667,00
Soportes	\$ 4.522,00	\$ 4.490,00	\$ 4.431,00

NIVELES TÉCNICOS – EUR / USD			
Resistencias	€ 0,9653	€ 0,9713	€ 0,9816
Soportes	€ 0,9550	€ 0,9507	€ 0,9404

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	0.9582	-0,13%
GBPUSD	1,0639	-0,88%
USDCHF	0.9869	-0,48%
USDCAD	1,3702	-0,16%
USDJPY	144,4600	-0,23%
AUDUSD	0.6438	0,05%
USDMXN	20,3220	-0,30%
USDBRL	5,3576	-0,42%
USDCLP	976,1400	-1,13%

TIPOS DE INTERÉS DE LOS BANCOS CENTRALES		
Banco Central	Tasa de interés	Próxima reunión
JDBR	9,00%	29/09/2022
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	\$ 21.291,50
	Plazo	Limitado
Demanda		10.533,00
% Cupo aprobado		49,47%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	11,8881

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU	29,154.63	0,07%
SPX	3,647.29	-0,21%
CCMP	10,784.47	-0,42%
COLCAP	1.122,98	-0,83%
INMEX	2.786,77	0,66%
IBOV	108.477,41	0,09%
UKX	6,960.70	-0,34%
CAC	5,721.13	-0,57%
NKY	26,173.98	-1,50%

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Var cor. año
IBR Overnight TN	9,009%	6,10%
IBR 1 mes TN	10,247%	7,28%
IBR 3 meses TN	10,969%	7,55%
DTF EA	10,90%	7,68%
DTF TA	10,21%	7,06%
TRM	4556,42	14,45%
DEV(cor. año)EA	14,45%	27,07%
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

🇲🇵 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.
●	-	9,80%	7,90%

🇲🇵 Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	8,50%	8,50%

🇨🇳 PMI Compuesto Markit			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	50,20	49,50

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

### VIERNES

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

🇺🇸 Inflación PCE (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-	6,30%

🇨🇷 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.