

Informe Diario DE MERCADO Octubre 03 de 2023

PESO COLOMBIANO

Ayer el USDCOP abrió en \$4.100, siendo el mínimo de la jornada, con un gap alcista de \$21,5 respecto al cierre anterior (\$4.078,50). Posteriormente, fue presionado al alza hasta \$4.165,30, cerrando muy cerca de este nivel en \$4.161, con una variación diaria de 2,02%. El volumen de negociación fue de \$US 0,88B, por debajo del promedio año corrido (\$US 1,16B). En la jornada de hoy, el USDCOP podría operar entre \$4.130 y \$4.200.

DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF se desvalorizó 12pbs ayer con relación al 29 de septiembre, siguiendo el comportamiento de los tesoros americanos (+6pbs). En esta línea, los TES UVR se desvalorizaron 3pbs.

COLOMBIA

El Ministerio de Hacienda informó que este mes habrá una pausa en los incrementos en el precio del galón de gasolina tras casi un año de aumentos. De esta manera, el precio promedio del galón de gasolina se mantiene en \$13.964. Esta pausa se da a pesar de los incrementos en los precios de las referencias de petróleo durante septiembre, teniendo en cuenta que el Brent cotiza hoy por encima de los \$US90 por barril.

El PMI manufacturero aumentó ligeramente hasta 47,8pts en septiembre desde los 46,8pts de agosto, permaneciendo en zona de contracción (<50pts) por quinto mes consecutivo. Este comportamiento fue explicado por la reducción de volumen de producción de las empresas, ante menores flujos de nuevos pedidos, contracción de la demanda y el complejo entorno económico, lo que llevó a que las

empresas recortaran su fuerza laboral. Sin embargo, en cuanto al lado positivo, la moderación de la demanda ha llevado a que los precios bajen por el lado de los proveedores y fabricantes.

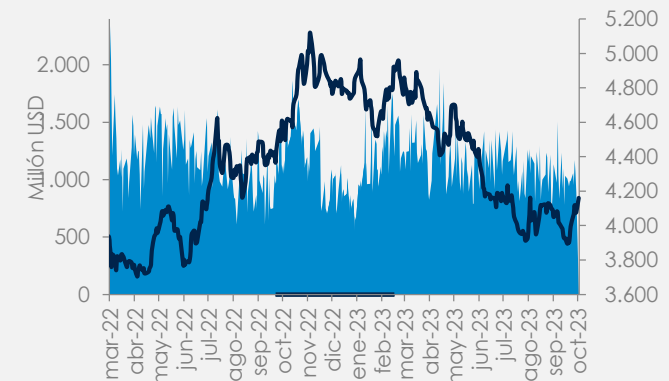
ESTADOS UNIDOS

Michael Barr, vicepresidente de la Reserva Federal (FED), afirmó que la FED debe proceder con cautela en la política monetaria, haciendo énfasis en que el centro de atención no es cuánto se debe subir la tasa de interés, si no cuánto tiempo debe mantenerse en un nivel suficientemente restrictivo para llevar la inflación al objetivo del 2%. Resaltando que la inflación ha tenido avances positivos, pasando del 9,1% a/a en junio de 2022 al 3,7% a/a registrado en agosto, y que el mercado laboral continúa moderándose, con un mejor equilibrio entre la oferta y la demanda. Por su parte, Michelle Bowman, Gobernadora de la FED, explicó que continuaba dispuesta a apoyar un incremento adicional de tasa de interés y Loretta Mester, jefa de la Reserva Federal de Cleveland, anunció que era posible que se requiriera un aumento de tasa de interés.

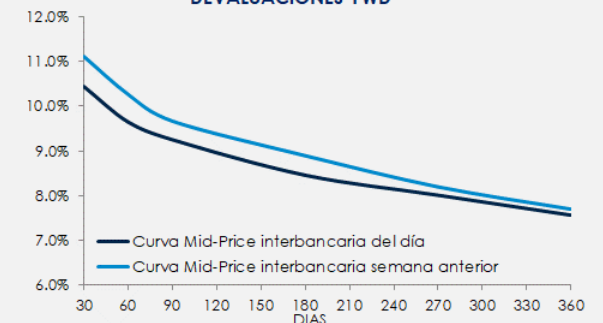
Los datos del ISM sobre el sector manufacturero sorprenden al mercado con una recuperación mayor a la prevista. En septiembre, el ISM manufacturero subió 0,14 pts desde 47,6 pts hasta 49,0 pts, superando las expectativas del mercado (47,7 pts), aunque se mantiene en terreno contractivo (<50 pts) desde octubre de 2022. La mejor dinámica de las fábricas estadounidenses se vio explicada por una mayor producción, una recuperación del empleo y por una reducción en los precios de los insumos.

Datos a Monitorear				
Indicador	País	Esp.	Anl.	Hora
Encuesta JOLTS		8.830M	8.827K	9:00 a.m.
Exportaciones		-	-30.80%	11:00 a.m.

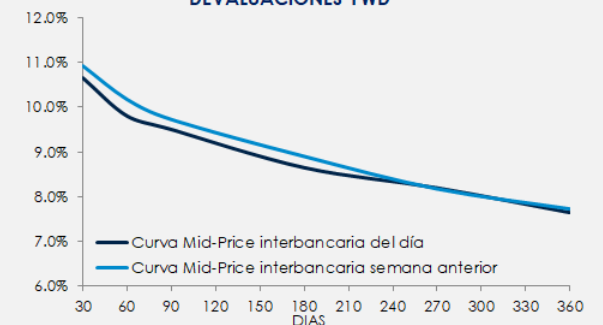
Cotización Tasa Peso - Dólar



DEVALUACIONES FWD



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	\$ 4,053.76	\$ 4,165.30	\$ 4,100.00	\$ 4,161.00
HOY	\$ 4,141.43	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4,184.20	\$ 4,207.40	\$ 4,272.70
Soportes	\$ 4,118.90	\$ 4,076.80	\$ 4,011.50

NIVELES TÉCNICOS - EUR / USD			
Resistencias	€ 1.0554	€ 1.0630	€ 1.0745
Soportes	€ 1.0439	€ 1.0400	€ 1.0285

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	1.0467	-0.10%
GBPUSD	1.2073	-0.12%
USDCHF	0.9226	-0.47%
USDCAD	1.3701	-0.18%
USDJPY	149.9500	-0.06%
AUDUSD	0.6306	-0.90%
USDMXN	17.7446	-0.39%
USDBRL	5.0820	-0.39%
USDCLP	912.5300	-0.44%

TIPOS DE INTERÉS DE LOS BANCOS CENTRALES

Banco Central	Tasa de interés	Próxima reunión
JDBR	13.25%	31-oct-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	\$ 17,000.00
	Plazo	Limitado
Demanda		16,015.00
% Cupo aprobado		94.21%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	
8.6400	

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU**	33,492.00	-0.43%
SPX**	4,299.50	-0.57%
CCMP**	14,877.00	-0.72%
COLCAP	1,112.80	-0.79%
INMEX	3,170.62	0.75%
IBOV	115,056.86	-1.29%
UKX	7,495.57	-0.20%
CAC	7,009.98	-0.82%
NKY	31,237.94	-1.64%

** Futuros

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Variación diaria
IBR Overnight TN	12.295%	0.07%
IBR 1 mes TN	12.322%	-0.05%
IBR 3 meses TN	12.330%	0.11%
DTF EA	12.71%	0.00%
DTF TA	11.79%	0.00%
TRM	4141.43	2.16%
Petróleo BRENT	90.37	-0.37%
Indicador	ago-23	ago-22
IPC-anual EA	11.43%	10.84%
IPC-mensual EA	0.70%	1.02%

Hora de actualización: 7:54 a.m.

Informe Diario de Mercado CALENDARIO ECONÓMICO

Calendario Oct 02 - Oct 06

FIN DE SEMANA/ LUNES

Inflación (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	5.31%	5.04%	5.38%

ISM Manufacturero			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	49.0	47.7	47.6

Comparecencia Michael Barr, miembro Fed			

MARTES

Encuesta JOLTS			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	8.830M	8.827K

Exportaciones			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-	-30.80%

MIÉRCOLES

IPP (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-11.60%	-7.60%

Reunión OPEP			

Encuesta ADP			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	150K	177K

JUEVES

Balanza Comercial SUD			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	16.0B	15.9B

Balanza Comercial USD			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	-65.1B	-65.0B

Decisión de tasa de interés			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	7.25%	7.50%

VIERNES

Inflación (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	5.00%	5.30%

Nóminas no agrícolas			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●		150K	177K

Tasa de desempleo			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	3.7%	3.8%

Inflación (a/a)			
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.
●	-	10.98%	11.43%

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.