

# Informe Diario DE MERCADO

## Octubre 04 de 2022

### PESO COLOMBIANO

Ayer el USDCOP abrió en el máximo de la jornada \$4.580, con un gap bajista de \$30 respecto al cierre anterior (\$4.610), posteriormente fue presionado a la baja hasta \$4.513 y cerró en \$4.530,01, con una variación diaria de -1,74%. El volumen de negociación fue \$US 953M, por debajo del promedio año corrido (\$US 1,16B). Para la jornada de hoy el USDCOP podría operar entre \$4.450 y \$4.500.

### DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF descendió 12pbs ayer con relación al 30 de septiembre (valorizándose los títulos), en línea con el desempeño de los tesoros americanos (-5pbs). Por su parte, los TES UVR presentaron un comportamiento mixto con valorizaciones en TES UVR 2033 (-6pbs), TES UVR 2027 (-5pbs), TES UVR 2049 (-4pbs) y desvalorizaciones en los TES UVR 2023 (+13pbs) y TES UVR 2025 (+3pbs).

### COLOMBIA

Según las minutas de la reunión de política monetaria del 29 de septiembre, 6 miembros de la Junta Directiva del Banco de la República (JDBR) estuvieron a favor de aumentar la tasa de interés en 100pbs, mientras que el miembro restante consideró oportuno elevarla en tan solo 50pbs. Este último argumentó su decisión teniendo en cuenta: i) el impacto de los incrementos de la tasa (+825pbs desde septiembre de 2021) sobre la actividad económica (productividad y empleo) y ii) la trayectoria de los tipos de referencia no ha generado estabilidad en los precios, por lo que las presiones inflacionarias se deben a choques de oferta. Además, la JDBR reiteró su compromiso de hacer lo

necesario para que la inflación converja al rango objetivo (2% - 4%), por lo que realizarán aumentos adicionales en las próximas reuniones.

Las exportaciones fueron \$US 4.582M en agosto (32,2% a/a), este comportamiento se explica principalmente por las ventas externas del grupo de combustibles (57,2% a/a), destacando la exportación de 15,7M de barriles de petróleo (18,9% a/a). Los principales destinos de exportación fueron Estados Unidos (con una participación de 24,4%), Panamá (11,1%) y España (6,1%).

### ESTADOS UNIDOS

El ISM manufacturero cayó 1,9pts en septiembre hasta 50,9pts, por debajo de lo esperado por el mercado (52,2pts) y del dato de agosto (52,8pts), alcanzando el nivel más bajo desde mayo de 2020. Este comportamiento se explicó por la caída de nuevos pedidos, en línea con los aumentos de tasas de interés de la Reserva Federal, que lleva a las empresas a prepararse para una posible caída de la demanda si se da una recesión.

### REINO UNIDO

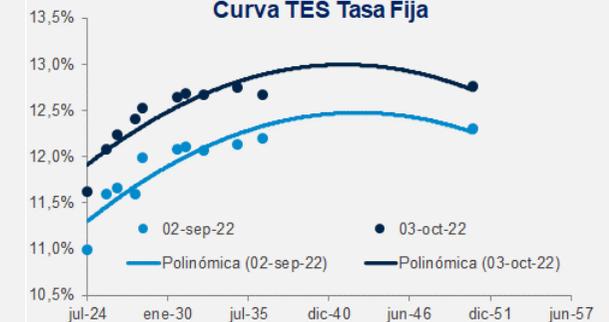
El Índice de Precios al Productor (IPP) subió 43,3% a/a en agosto, el máximo histórico y ubicándose por encima de lo esperado por el mercado (37,9% a/a) y del dato registrado en julio (38,0% a/a). Este comportamiento obedeció a los mayores precios de la energía (116,6% a/a). Al excluir los precios de la energía, el IPP creció 14,5% a/a, por debajo de lo registrado en julio (15,1% a/a).

Datos a Monitorear				
Indicador	País	Esp.	Ant.	Hora
IPP (a/a)		-	30,02%	2:00 PM

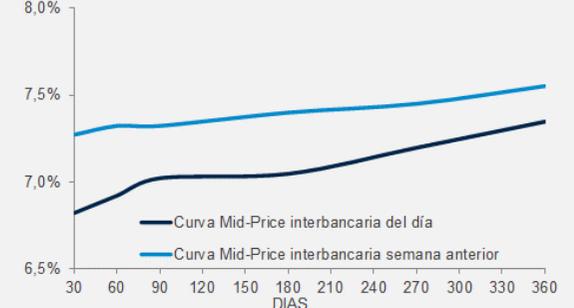
### Cotización Tasa Peso - Dólar



### 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	\$ 4.532,07	\$ 4.580,00	\$ 4.513,00	\$ 4.530,01
HOY	\$ 4.545,66	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4.569,01	\$ 4.608,00	\$ 4.675,00
Soportes	\$ 4.502,01	\$ 4.474,00	\$ 4.407,00

NIVELES TÉCNICOS - EUR / USD			
Resistencias	€ 0,9868	€ 0,9901	€ 0,9992
Soportes	€ 0,9777	€ 0,9719	€ 0,9628

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	0,9913	0,89%
GBPUSD	1,1354	0,27%
USDCHF	0,9860	-0,63%
USDCAD	1,3644	0,15%
USDJPY	144,7400	0,13%
AUDUSD	0,6476	-0,61%
USDMXN	199627,0000	-0,33%
USDBRL	51479,0000	-0,45%
USDCLP	9299500,0000	-0,88%

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	\$ 19.630,00
	Plazo	Limitado
Demanda		16.041,59
% Cupo aprobado		81,72%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	11,6200

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU	29,490.89	2,66%
SPX	3,678.43	2,59%
CCMP	10,815.43	2,27%
COLCAP	1.156,70	2,52%
INMEX	2.805,91	1,95%
IBOV	117.913,65	1,53%
UKX	7,048.04	2,02%
CAC	5,987.65	3,34%
NKY	26,992,21	2,96%

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Var cor. año
IBR Overnight TN	10,013%	7,11%
IBR 1 mes TN	10,160%	7,19%
IBR 3 meses TN	10,763%	7,35%
DTF EA	11,08%	7,86%
DTF TA	10,37%	7,21%
TRM	4545,66	14,18%
DEV(cor. año)EA	14,18%	26,60%
Petróleo BRENT	88,97	14,06%
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 Oct 03 - Oct 07

PMI Manufacturero (R)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	47,8	48,3	49,1	

PMI Manufacturero (R)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	48,4	48,5	49,6	

ISM Manufacturero				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	50,9	52,2	52,8	

Exportaciones				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	32,20%	-	71,70%	

### MARTES

IPP (a/a)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	43,30%	43,10%	38,00%	

IPP (a/a)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	-	30,02%	

### MIÉRCOLES

Balanza Comercial				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	4,0B	5,4B	

PMI Compuesto (R)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	48,2	48,2	

IPC (a/a)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	11,08%	10,84%	

Balanza Comercial				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	-68,00B	-70,70B	

### JUEVES

Decisión de tasa de interés				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	-	6,75%	

PMI Manufacturero Caixin				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	-	49,50	

### VIERNES

IPC (a/a)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	8,67%	8,70%	

IPC (a/a)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	11,08%	10,84%	

Nóminas no agrícolas				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	250K	315K	

Tasa de desempleo				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	3,7%	3,7%	

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.