

# Informe Diario DE MERCADO

## Octubre 03 de 2022

### PESO COLOMBIANO

El 30 de septiembre el USDCOP abrió en \$4.559,60 con un gap alcista de \$30,91 respecto al cierre anterior (\$4.528,69). Al comenzar la jornada el par llegó al mínimo de \$4.542, posteriormente fue presionado al alza al \$4.615,5 y cerró en \$4.610, con una variación diaria de 1,80%. El volumen de negociación fue \$US 1,45B, por encima del promedio año corrido (\$US 1,16B). Para la jornada de hoy el USDCOP podría operar entre \$4.550 y \$4.600.

### DEUDA PÚBLICA

La curva de rendimientos de los TES TF se redujo 4pbs (valorizándose los títulos) con excepción de los TES TF 2027 (+4pbs), TES UVR 2032 (+2pbs), TES TF 2042 (+6pbs) y TES TF 2050 (+9pbs) que se desvalorizaron. Por su parte, los TES UVR presentaron un comportamiento mixto con valorizaciones en TES UVR 2025 (-10pbs), TES UVR 2029 (-5pbs), TES UVR 2035 (-3pbs) y desvalorizaciones en los TES UVR 2027 (+13pbs), y TES UVR 2049 (+2pbs), luego de adjudicarse la subasta no competitiva de los bonos con vencimiento en febrero de 2037 y junio de 2049.

### COLOMBIA

El Presidente Gustavo Petro recalcó la necesidad de reformar el Marco Fiscal de Mediano Plazo para lograr la paz total, de manera que se priorice la compra de tierras, lo que implica un esfuerzo presupuestal adicional de \$30B a \$60B. Esto sería parte de la reforma agraria que busca adelantar el Gobierno con: i) catastro multipropósito, ii) aumento de impuestos para las tierras fértiles improductivas y iii) prioridad a la compra de predios como inversión pública.

### BRASIL

El 2 de octubre se llevó a cabo las elecciones presidenciales, con el 99% de los votos escrutados, el candidato del Partido de los Trabajadores (PT) con ideología de

izquierda, Luiz Inácio Lula de Silva, obtuvo el 48,4% de los votos, mientras que el candidato del Partido Liberal que tiene ideología de derecha y es el actual presidente del país, Jair Bolsonaro, obtuvo el 43,2% de los votos. Con este resultado, dado que ningún candidato obtuvo más del 50% de los votos requeridos para obtener la presidencia, se llevará a cabo la segunda vuelta de elecciones el próximo 30 de octubre. Por su parte, el Congreso Nacional, que se encuentra conformado por el Senado y la Cámara de Diputados, obtuvo la mayoría el Partido Liberal, es decir que en caso que Bolsonaro gane la presidencia, tendría la fortaleza en estas cámaras para las decisiones del nuevo gobierno.

### REINO UNIDO

El Gobierno revocó el recorte propuesto a la tasa máxima del impuesto sobre la renta debido a los riesgos políticos y económicos. Lo anterior llevó a que la libra esterlina (GBP) se revaluara en la jornada del 3 de octubre 0,49% hasta GBP 1,1255, a medida que esta decisión le resta presión al Banco de Inglaterra de implementar una política monetaria más contractiva (incrementos en tasas superiores a 75pbs) ya que un recorte de impuestos le daría mayor capacidad de consumo a hogares y empresas, lo cual generaría presiones inflacionarias adicionales.

### INTERNACIONAL

La Organización de Países Exportadores de Petróleo y sus Aliados (OPEP+) tendrá su reunión mensual el próximo 5 de octubre. De acuerdo con fuentes cercanas al grupo, la OPEP+ estaría discutiendo la posibilidad de recortar la producción de petróleo en 1Mbd el mayor recorte desde abril del 2020 cuando la pandemia comenzó. Bajo este contexto, en la mañana del 3 de octubre las referencias del WTI y Brent se valorizaron 4,65% y 4,20%, hasta \$US 83,19 y \$US 88,72 respectivamente.

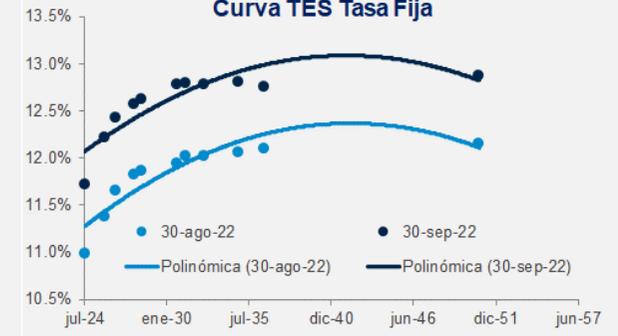
#### Datos a Monitorear

Indicador	País	Esp.	Ant.	Hora
Exportaciones		-	71.70%	10:00 a. m.

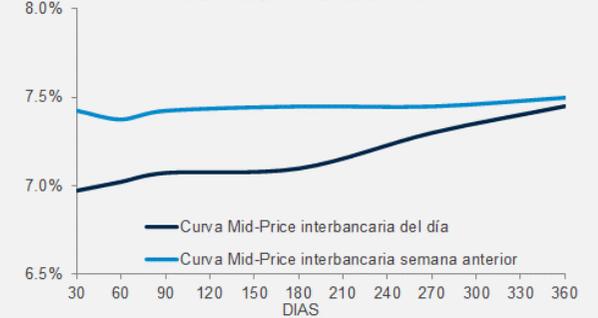
#### Cotización Tasa Peso - Dólar



#### 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	\$ 4,532.07	\$ 4,615.50	\$ 4,542.00	\$ 4,610.00
HOY	\$ 4,590.54	-	-	-

NIVELES TÉCNICOS - USD / COP			
Resistencias	\$ 4,636.33	\$ 4,662.67	\$ 4,736.17
Soportes	\$ 4,562.83	\$ 4,515.67	\$ 4,442.17

NIVELES TÉCNICOS - EUR / USD			
Resistencias	€ 0.9858	€ 0.9916	€ 1.0036
Soportes	€ 0.9738	€ 0.9676	€ 0.9556

MONEDAS		
Moneda	Precio	Variación diaria
EURUSD	0.9771	-0.32%
GBPUSD	1.1233	0.56%
USDCHF	0.9882	0.12%
USDCAD	1.3681	-1.07%
USDJPY	144.8600	0.08%
AUDUSD	0.6478	1.22%
USDMXN	20.0533	-0.42%
USDBRL	5.2329	-3.34%
USDCLP	957.2300	-1.15%

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%	2/11/2022
ECB	1.25%	27/10/2022
BOE	2.25%	3/11/2022
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		14,651.26
% Cupo aprobado		74.64%

MERCADO DE RENTA FIJA TES JULIO 2024 (%)	
Cierre jornada anterior	
11.7365	

ÍNDICES BURSÁTILES		
Índice	Valor	Variación diaria
INDU	28,725.51	-1.71%
SPX	3,585.62	-1.51%
CCMP	10,575.62	-1.51%
COLCAP	1,128.24	-0.66%
INMEX	2,752.30	1.20%
IBOV	110,201.74	0.15%
UKX	6,882.91	-0.16%
CAC	5,759.63	-0.05%
NKY	26,215.79	1.07%

INDICADORES ECONÓMICOS		
Indicador	Valor	Var cor. año
IBR Overnight TN	9.402%	6.50%
IBR 1 mes TN	9.465%	6.50%
IBR 3 meses TN	10.165%	6.75%
DTF EA	11.08%	7.86%
DTF TA	10.37%	7.21%
TRM	4590.54	15.31%
DEV(cor. año)EA	15.31%	28.58%
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.	
●	-	-	71.70%	

### MARTES

IPP (a/a)				
Imp.	Efec.	Esp.	Ant.	
●	-	43.20%	37.90%	

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.