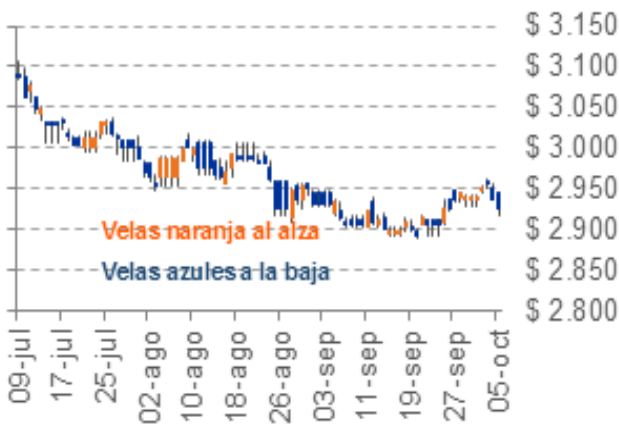


05 de octubre de 2017

Cotización diaria dólar interbancario		
Estadísticas diarias	Hoy	Anterior
Apertura	\$ 2.943,50	\$ 2.950,00
Cierre	\$ 2.925,60	\$ 2.935,30
Promedio	\$ 2.926,91	\$ 2.945,70
Cambio diario	0,33%	
Volatilidad	\$ 25,35	\$ 19,70
Monto millones USD	\$ 901	\$ 1.060

Tasa representativa del mercado	
Estadísticas	TRM
TRM vigente	\$ 2.945,59
TRM anterior	\$ 2.953,81
Cierre mes anterior	\$ 2.941,07
Cierre año anterior	\$ 3.000,71
365 días atrás	\$ 2.937,23
Depreciación mes corrido	0,15%
Depreciación año corrido	-1,84%
Depreciación 12 meses	0,28%
Con promedio de hoy	
Promedio del día	\$ 2.926,91
Depreciación mes corrido	-0,48%
Depreciación año corrido	-2,46%
Depreciación 12 meses	-0,35%

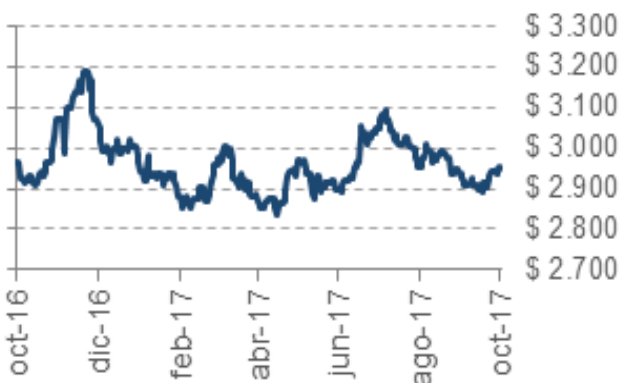
Comportamiento diario dólar, 90 días



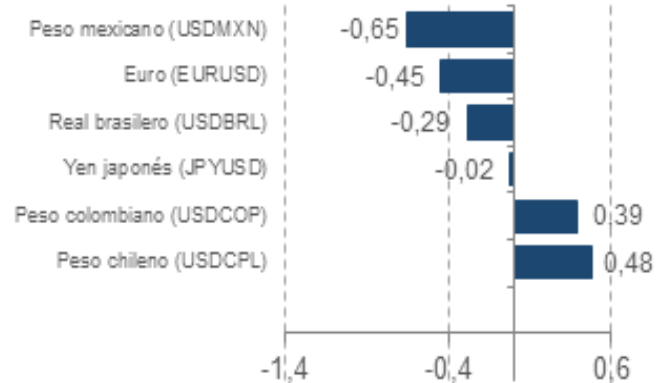
Volumen interbancario negociado, 365 días (millones USD)



Histórico tasa representativa del mercado (TRM), 365 días



Cambio diario de principales monedas (%)



VIGILADO SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Itaú Colplata Colombia S.A.

05 de octubre de 2017

Mercado de deuda pública - intradía, fuentes MEC y SEN								
Referencia	Hoy				Anterior	Cambio diario	1 mes atrás	3 meses atrás
	Apertura	Máximo	Mínimo	Cierre	Cierre		Cierre	Cierre

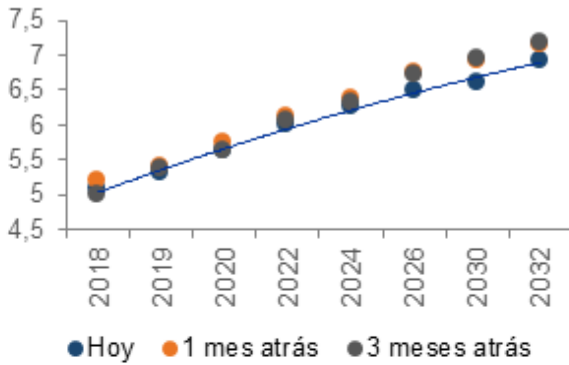
TES tasa fija								
21-nov-18	5,05	5,08	5,05	5,08	5,07	▲	5,20	5,00
09-nov-19	5,29	5,31	5,29	5,30	5,30	▲	5,40	5,36
24-jul-20	5,65	5,65	5,60	5,62	5,61	▲	5,74	5,63
04-may-22	5,98	6,00	5,97	5,99	5,99	◀▶	6,11	6,05
24-jul-24	6,23	6,26	6,22	6,25	6,23	▲	6,37	6,31
26-ago-26	6,47	6,51	6,46	6,49	6,46	▲	6,75	6,72
18-sep-30	6,62	6,62	6,61	6,61	6,60	▲	6,91	6,95
30-jun-32	6,91	6,94	6,91	6,92	6,91	▲	7,16	7,16

TES UVR								
17-abr-19	1,92	1,93	1,83	1,90	1,95	▼	1,95	2,18
10-mar-21	2,47	2,48	2,44	2,47	2,49	▼	2,49	2,68
23-feb-25	2,75	2,79	2,75	2,79	2,77	▲	2,77	3,03
25-mar-33		3,46			3,44	▲	3,44	3,68
04-abr-35	3,47	3,50	3,46	3,49	3,49	▲	3,49	3,69

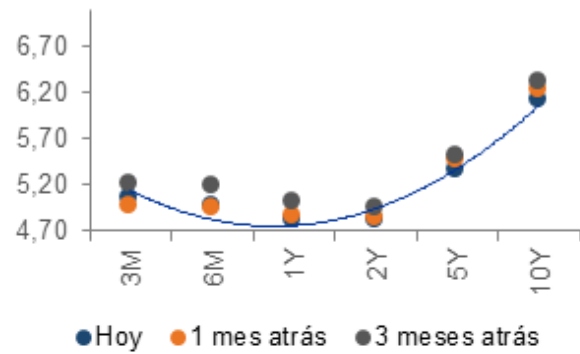
Mercado de IBR					
Referencia	Hoy*	Anterior	Cambio diario	1 mes atrás	3 meses atrás
3 meses	5,05	5,05	◀▶	4,98	5,20
6 meses	4,98	4,98	◀▶	4,95	5,18
1 año	4,81	4,81	▼	4,87	5,01
2 años	4,81	4,81	▼	4,83	4,96
5 años	5,35	5,35	◀▶	5,46	5,51
10 años	6,11	6,11	◀▶	6,23	6,30

* Las cifras de hoy no corresponden al cierre, pues la operación termina a las 4:00 pm hora colombiana

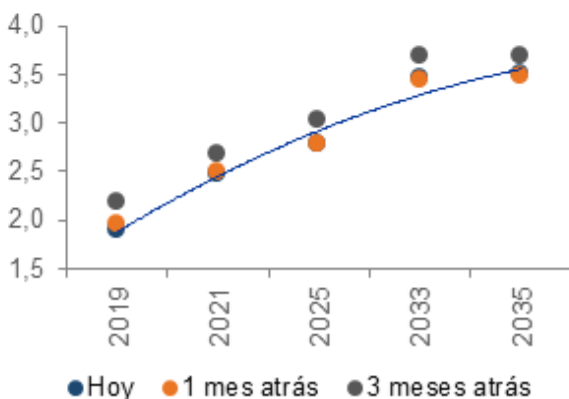
Curva de rendimientos TES tasa fija



Curva swap IBR



Curva de rendimientos UVR



Otros indicadores locales	
Índice	Lectura más reciente
IBR nominal	5,07
REPO E.A	5,25
DTF 90 días E.A	5,48
IPC mes	0,14
IPC año corrido	3,44
IPP 12 meses	3,87
PIB trimestral anualizado	1,18

Itaú Colpatria Colombia S.A.

05 de octubre de 2017

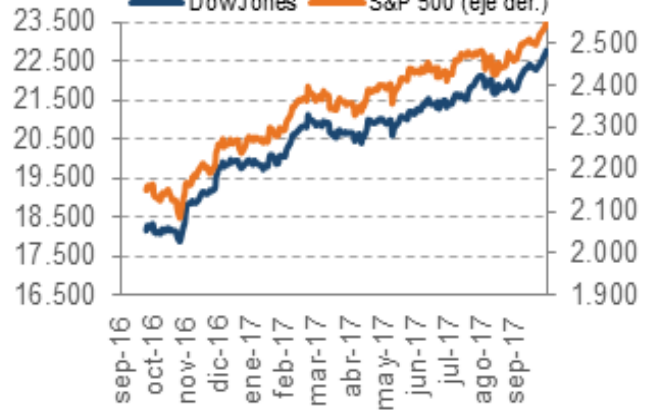
Mercados bursátiles internacionales					
Índice	País	Cambio diario	Hoy	Cierre anterior	Variación de un día
HSI Index	Hong Kong	▲	28379,18	28173,21	0,73%
CCMP Index	EE. UU.	▲	6576,13	6534,63	0,64%
NKY Index	Japón	▲	20628,56	20626,66	0,01%
SX5P Index	Europa	▲	3199,59	3192,76	0,21%
SPTSX Index	Canadá	▲	15785,55	15721,00	0,41%
IBEX Index	España	▲	10214,70	9964,90	2,51%
SPX Index	EE. UU.	▲	2550,59	2537,74	0,51%
CAC Index	Francia	▲	5379,21	5363,23	0,30%
DAX Index	Alemania	▼	12968,05	12970,52	-0,02%
UKX Index	Reino Unido	▲	7507,99	7467,58	0,54%
INDU Index	EE. UU.	▲	22763,05	22661,64	0,45%
AS51 Index	Australia	▼	5651,77	5652,06	-0,01%
MEXBOL Index	México	▲	50754,51	50565,29	0,37%
Colcap Index	Colombia	▲	1486,67	1484,12	0,17%
IBOV Index	Brasil	▲	77243,54	76591,44	0,85%

Acciones colombianas con mayores variaciones					
Acción	Hoy	Cierre anterior	Cambio diario	Variación diaria	Variación de un mes
Cementos Argos Sa	\$ 11.820	\$ 11.700	▲	1,03%	-1,50%
Celsia Sa Esp	\$ 4.690	\$ 4.650	▲	0,86%	-2,09%
Grupo Argos Sa	\$ 20.980	\$ 20.840	▲	0,67%	0,48%
Almacenes Exito Sa	\$ 15.720	\$ 15.620	▲	0,64%	2,21%
Interconexion Electrica Sa	\$ 13.780	\$ 13.700	▲	0,58%	1,03%
Grupo Aval Acciones Sa -Pf	\$ 1.320	\$ 1.325	▼	-0,38%	-1,49%
Bolsa De Valores De Colombia	\$ 25	\$ 25	▼	-0,41%	-6,49%
Avianca Holdings Sa	\$ 2.835	\$ 2.855	▼	-0,70%	-2,24%
Grupo Aval Acciones Y Val Sa	\$ 1.320	\$ 1.330	▼	-0,75%	-0,38%
Canacol Energy Ltd	\$ 9.860	\$ 9.950	▼	-0,90%	-0,30%

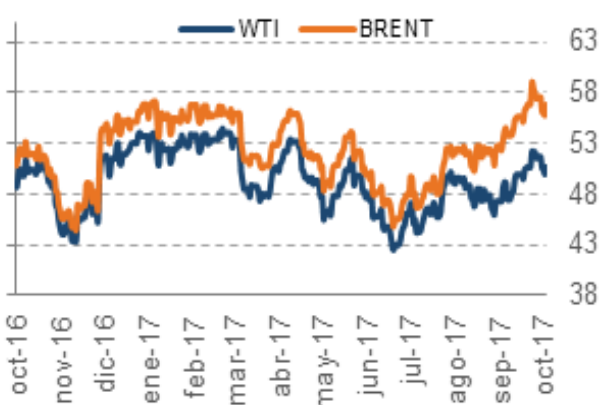
Comportamiento intradía Colcap



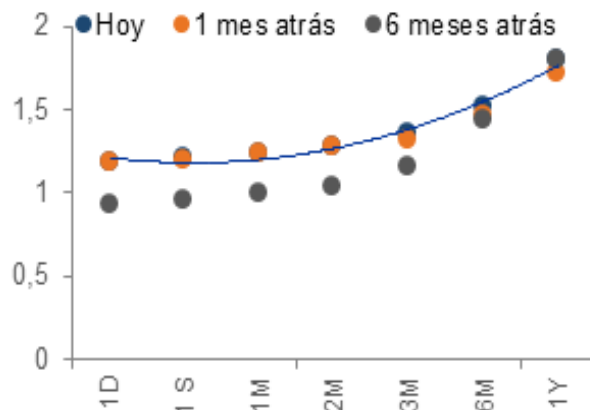
Dow Jones y S&P 500, 365 días



Comportamiento 365 días de petróleo



Curva Libor (USD)



VIGILADO SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Itaú Colpatria Colombia S.A.

Información relevante

La información contenida en este informe fue producida por Itaú CorpBanca Colombia S.A, a partir de las condiciones actuales del mercado y las recientes coyunturas económicas, basada en información y datos obtenidos de fuentes públicas, que se consideran fidedignas, pero cuya veracidad no se garantiza. Esta información no constituye y, en ningún caso, debe interpretarse como una oferta de negocio jurídico o solicitud para comprar o vender algún instrumento financiero, o para participar en una estrategia de negocio en particular en cualquier jurisdicción. Toda la información y estimaciones que aquí se presentan derivan de nuestros estudios internos y pueden ser modificadas en cualquier momento sin previo aviso. Itaú CorpBanca Colombia S.A. no asume ningún tipo de responsabilidad legal por las decisiones de inversión basadas en la información contenida y divulgada en este documento. Asimismo, el presente documento de análisis no puede entenderse como Asesoría en los temas que trata por parte de quien lo recibe.

Este informe fue preparado y publicado por el área de Itaú Análisis Económico de Itaú CorpBanca Colombia S.A. Este material es para uso exclusivo de sus receptores y su contenido no puede ser reproducido, publicado o redistribuido en ninguna forma, en todo o en parte, sin la autorización previa de Itaú CorpBanca Colombia S.A

Directorio de contactos

Análisis económico

Ángela González Arbeláez
Angela.gonzaleza@itau.co
(571) 644 8024

Carolina Monzón Urrego
Carolina.monzon@itau.co
(571) 644 8006

Santiago Dueñas Peña
Santiago.duenas@itau.co
(571) 6448006 ext 19563

Gerente de tesorería

Ricardo Castañeda
Ricardo.castaneda@itau.co
(571) 644 8931

Trader Institucional

Rafael Guzmán
Rafael.guzman@itau.co
(571) 327 6012

Gerente de mesa de distribución y ventas

Alejandro Tschudy
Alejandro.tschudy@itau.co
(571) 644 8127

Head Trader Pymes y personas

Luis Fernando Vanegas
Luis.vanegas@itau.co
(571) 327 6017

Head Trader Banca Empresas e Instituciones

Andrés Nemesio Rodríguez
Andres.rodriquez@itau.co
(571) 644 8935

Contacto General Tesorería

(571) 644 8362



Encuentre este y otros reportes en nuestra página web
www.itau.co sección Itaú Análisis Económico



Contáctenos en:
macroeconomia@itau.co