

# Mercados a la 1



18 de diciembre de 2017

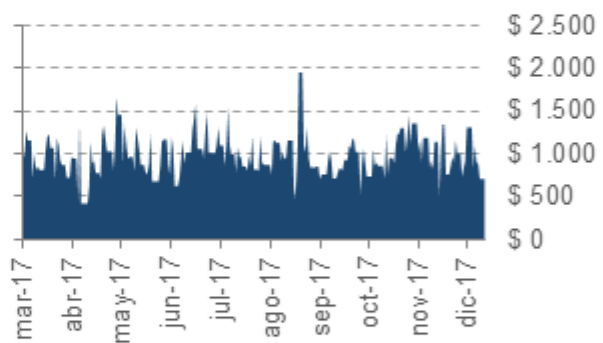
Cotización diaria dólar interbancario		
Estadísticas diarias	Hoy	Anterior
Apertura	\$ 2.990,00	\$ 2.996,00
Cierre	\$ 2.976,00	\$ 2.999,80
Promedio	\$ 2.974,99	\$ 2.996,58
Cambio diario	0,80%	
Volatilidad	\$ 28,91	\$ 11,00
Monto millones USD	\$ 121	\$ 705

Tasa representativa del mercado	
Estadísticas	TRM
TRM vigente	\$ 2.996,61
TRM anterior	\$ 2.999,07
Cierre mes anterior	\$ 3.006,09
Cierre año anterior	\$ 3.000,71
365 días atrás	\$ 3.000,47
Depreciación mes corrido	-0,32%
Depreciación año corrido	-0,14%
Depreciación 12 meses	-0,13%
Con promedio de hoy	
Promedio del día	\$ 2.974,99
Depreciación mes corrido	-1,03%
Depreciación año corrido	-0,86%
Depreciación 12 meses	-0,85%

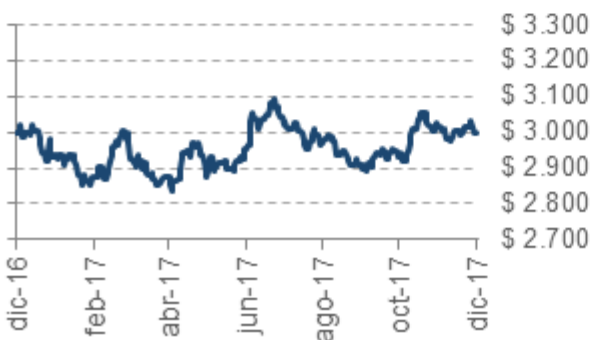
Comportamiento diario dólar Next day , 90 días



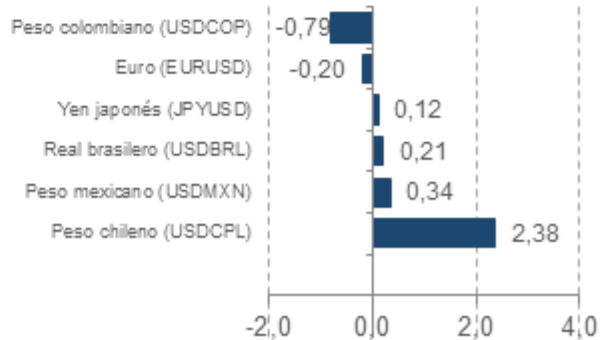
Volumen interbancario negociado, 365 días (millones USD)



Histórico tasa representativa del mercado (TRM), 365 días



Cambio diario de principales monedas (%)



VIGILADO SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

Itaú Colpatria Colombia S.A.

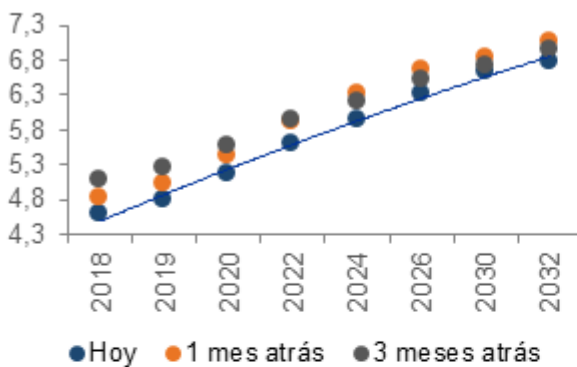
18 de diciembre de 2017

Mercado de deuda pública - intradía, fuentes MEC y SEN								
Referencia	Hoy				Anterior	Cambio diario	1 mes atrás	3 meses atrás
	Apertura	Máximo	Mínimo	Cierre				
<b>TES tasa fija</b>								
21-nov-18	4,60	4,61	4,58	4,59	4,61	▼	4,82	5,07
09-nov-19	4,79	4,79	4,78	4,79	4,81	▼	5,03	5,25
24-jul-20	5,18	5,19	5,13	5,16	5,19	▼	5,43	5,57
04-may-22	5,59	5,63	5,59	5,60	5,62	▼	5,90	5,94
24-jul-24	6,00	6,01	5,94	5,95	6,01	▼	6,32	6,19
26-ago-26	6,38	6,39	6,30	6,31	6,40	▼	6,65	6,50
18-sep-30	6,64	6,65	6,61	6,63	6,70	▼	6,82	6,71
30-jun-32	6,83	6,83	6,77	6,77	6,84	▼	7,07	6,93
<b>TES UVR</b>								
17-may-17	/A Real T	/A Real T	/A Real T	/A Real T	/A Real T	▲		
17-abr-19	1,24	1,24	1,18	1,20	1,25	▼	1,25	1,87
10-mar-21	2,16	2,18	2,14	2,15	2,17	▼	2,17	2,52
23-feb-25	2,68	2,73	2,68	2,73	2,67	▲	2,67	2,98
25-mar-33	3,46	3,50	3,46	3,50	3,48	▲	3,48	3,601
04-abr-35	3,47	3,49	3,46	3,47	3,48	▼	3,48	3,61

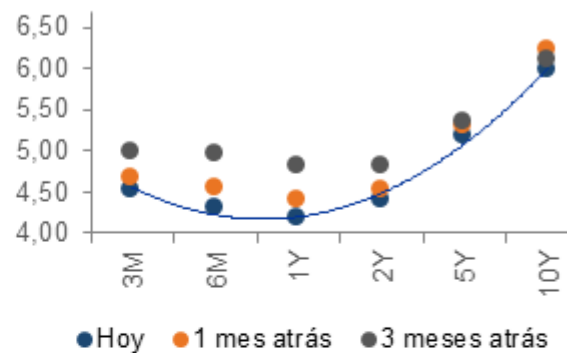
Mercado de IBR					
Referencia	Hoy*	Anterior	Cambio diario	1 mes atrás	3 meses atrás
3 meses	4,52	4,50	▲	4,67	4,99
6 meses	4,30	4,32	▼	4,55	4,96
1 año	4,18	4,19	▼	4,40	4,82
2 años	4,39	4,42	▼	4,51	4,82
5 años	5,18	5,19	▼	5,31	5,36
10 años	5,98	6,04	▼	6,22	6,11

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

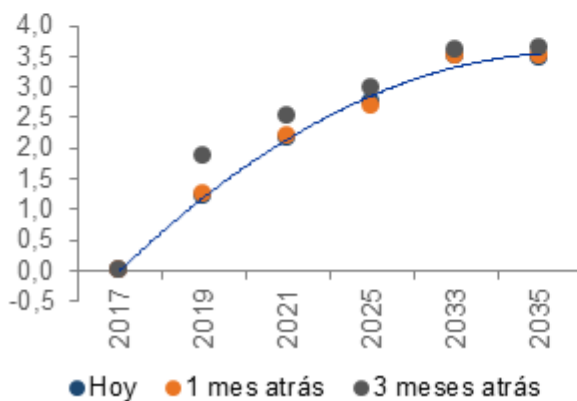
Curva de rendimientos TES tasa fija



Curva swap IBR



Curva de rendimientos UVR



Otros indicadores locales	
Índice	Lectura más reciente
IBR nominal	4,57
REPO E.A	4,75
DTF 90 días E.A	5,34
IPC mes	0,18
IPC año corrido	3,69
IPP 12 meses	4,12
PIB trimestral anualizado	1,31

VIGILADO SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

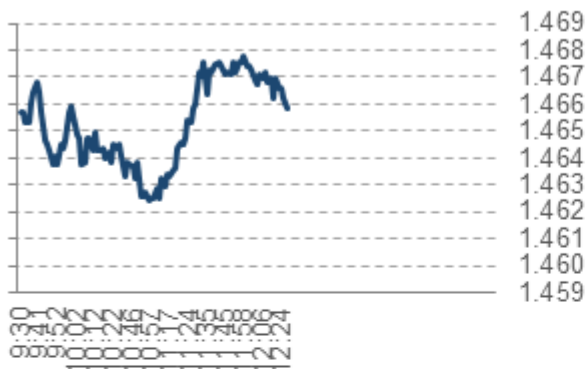
Itaú Colpatria Colombia S.A.

18 de diciembre de 2017

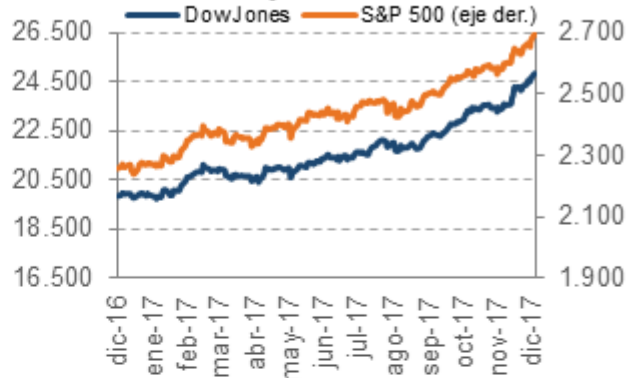
Mercados bursátiles internacionales					
Índice	País	Cambio diario	Hoy	Cierre anterior	Variación (%) de un día
DAX Index	Alemania	▲	13312,30	13103,56	-0,02
NKY Index	Japón	▲	22901,77	22553,22	-0,02
CAC Index	Francia	▲	5420,58	5349,30	-0,01
MEXBOL Index	México	▲	48661,98	48081,55	-0,01
SX5P Index	Europa	▲	3217,61	3184,47	-0,01
IBOV Index	Brasil	▲	73248,16	72607,70	-0,01
CCMP Index	EE. UU.	▲	6998,17	6936,58	-0,01
IBEX Index	España	▲	10244,10	10150,40	-0,01
SPTSX Index	Canadá	▲	16179,90	16041,98	-0,01
INDU Index	EE. UU.	▲	24812,95	24651,74	-0,01
HSI Index	Hong Kong	▲	29050,41	28848,11	-0,01
AS51 Index	Australia	▲	6038,93	5996,97	-0,01
SPX Index	EE. UU.	▲	2694,18	2675,81	-0,01
UKX Index	Reino Unido	▲	7537,01	7490,57	-0,01
Colcap Index	Colombia	▲	1465,44	1465,02	0,00

Acciones colombianas con mayores variaciones					
Acción	Hoy	Cierre anterior	Cambio diario	Variación (%) diaria	Variación (%) un mes
Bancolombia Sa	\$ 29.100	\$ 28.800	▲	0,01	0,01
Cementos Argos Sa	\$ 10.920	\$ 10.820	▲	0,01	0,00
Grupo De Inv Suramericana-Pf	\$ 38.100	\$ 37.800	▲	0,01	0,02
Almacenes Exito Sa	\$ 16.460	\$ 16.440	▲	0,00	0,00
Ecopetrol Sa	\$ 1.935	\$ 1.935	◄►	0,00	0,11
Cemex Latam Holdings Sa	\$ 10.820	\$ 10.860	▼	0,00	-0,03
Grupo Aval Acciones Sa -Pf	\$ 1.280	\$ 1.285	▼	0,00	-0,01
Interconexion Electrica Sa	\$ 14.020	\$ 14.120	▼	-0,01	0,06
Canacol Energy Ltd	\$ 9.710	\$ 9.790	▼	-0,01	-0,03
Avianca Holdings Sa	\$ 2.950	\$ 2.980	▼	-0,01	0,03

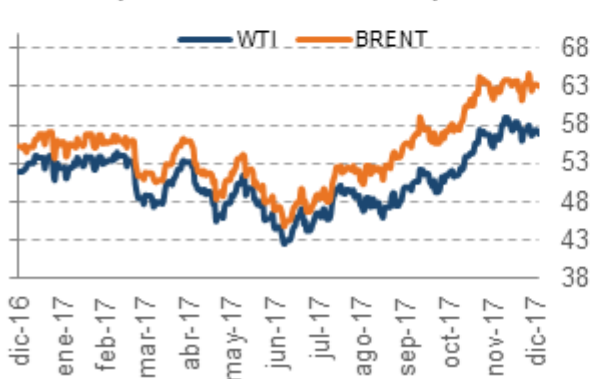
Comportamiento intradía Colcap



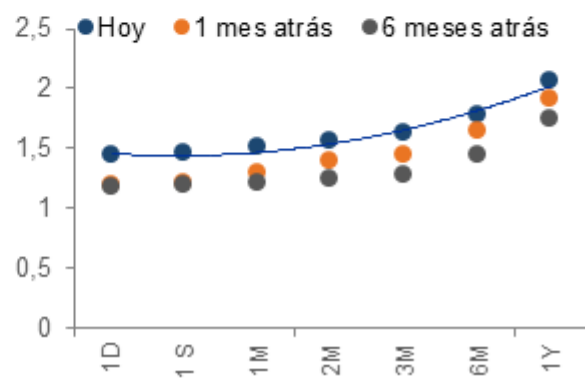
Dow Jones y S&P 500, 365 días



Comportamiento 365 días de petróleo



Curva Libor (USD)



VIGILADO SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

18 de diciembre de 2017

## 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

**Carolina Monzón Urrego**  
[Carolina.monzon@itau.co](mailto:Carolina.monzon@itau.co)  
(571) 644 8006

**Santiago Dueñas Peña**  
[Santiago.duenas@itau.co](mailto:Santiago.duenas@itau.co)

**Esteban Ortega López**

### Gerente de tesorería

**Ricardo Castañeda**  
[Ricardo.castaneda@itau.co](mailto:Ricardo.castaneda@itau.co)  
(571) 644 8931

### Trader Institucional

**Rafael Guzmán**  
[Rafael.guzman@itau.co](mailto:Rafael.guzman@itau.co)  
(571) 327 6012

### Gerente de mesa de distribución y ventas

**Alejandro Tschudy**  
[Alejandro.tschudy@itau.co](mailto:Alejandro.tschudy@itau.co)  
(571) 644 8127

### Head Trader Banca Empresas e Instituciones

**Luis Fernando Vanegas**  
[Luis.vanegas@itau.co](mailto:Luis.vanegas@itau.co)  
(571) 327 6017

**Contacto General Tesorería**  
(571) 644 8362



Encuentre este y otros reportes en nuestra página web  
[www.itau.co](http://www.itau.co) sección Itaú Análisis Económico



Contáctenos en:  
[macroeconomia@itau.co](mailto:macroeconomia@itau.co)