

## PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3081 soles 0,004 0,12%

1 de octubre de 2018

Dow Jones: 26651,21 192,9 0,73%

Última actualización 01/10/2018 17:58

### CONTEXTO DE HOY\*

En la sesión de hoy, los mercados de EEUU cerraron con resultados mixtos impulsados por el acuerdo comercial alcanzado entre EEUU y Canadá para sustituir el Tratado de Libre Comercio de América del Norte (TLCAN), eliminando la incertidumbre comercial en la región. En ese contexto, la curva del Tesoro de EEUU se elevó 1,7 puntos básicos (pb) en promedio en la sesión. El rendimiento del USTN 10 años se incrementó a 3,085% (anterior 3,062%) y el USTN 2 años mantuvo en 2,821% (anterior 2,821%). El dólar se apreció a nivel global en medio de una depreciación del euro, el yen y algunas monedas emergentes.

A nivel local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles se redujo en 2,1 pb en promedio, debido a una mayor demanda de papeles por parte de clientes corporativos. La negociación de bonos soberanos en soles en la jornada ascendió a S/ 211,46 millones según Datatec, de los cuales se compraron S/ 135,15 millones, vendieron S/ 21,00 millones y se transaron S/ 55,31 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2031 (S/ 55,0 millones) y 2032 (S/ 42,2 millones).

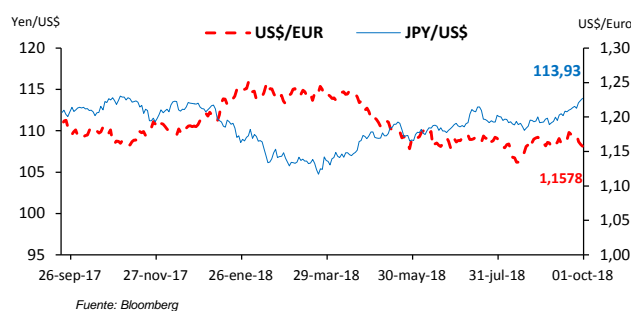
Por otro lado, el sol cerró el lunes en su menor nivel de cuatro sesiones debido a un alza del dólar en los mercados externos y una caída en el precio del cobre. Según Reuters, se negoció US\$ 396 millones en el mercado local en la sesión.

### DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var. %	Estado
Dólar (BBDXY)	1184,01	0,07	aprecia
Dólar (DXY)	95,30	0,17	aprecia
Euro	1,1578	-0,22	deprecia
Libra esterlina	1,3042	0,08	aprecia
Yen	113,93	0,20	deprecia
Yuan	6,869	0,00	sin variación
Sol	3,3081	0,12	deprecia

El **dólar BBDXY** se apreció a nivel global en medio de una depreciación del euro, el yen y algunas monedas emergentes.

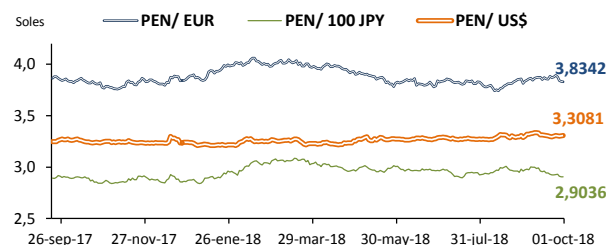


Fuente: Bloomberg

El **sol** se depreció en la jornada debido a una mayor demanda de ME por parte de empresas locales e inversores extranjeros.

En la jornada de hoy el **BCRP** no realizó compras de moneda extranjera.

Desde inicios del año 2018, la moneda nacional se ha depreciado **2,17%**.



Fuente: Bloomberg

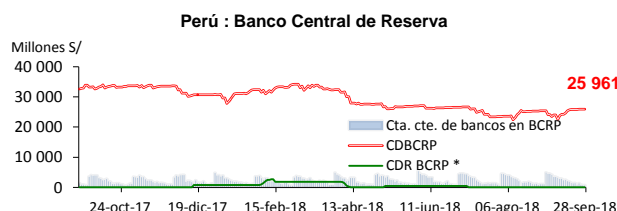
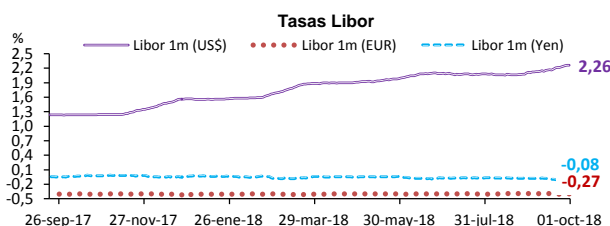
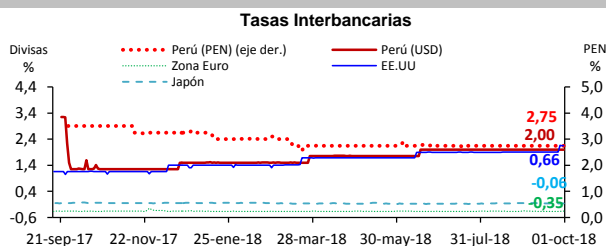
### LIQUIDEZ

El **BCRP** colocó **Repo de Valores Overnight** por S/ 700 millones a una tasa de interés promedio de 2,96% (01:35 pm), **Repo de Valores a 1 semana** por S/ 1 000 millones a una tasa de interés promedio de 2,94% (01:05 pm), **CD BCRP a 6 meses** por S/ 50 millones a una tasa de interés promedio de 2,66% (11:05 am), y **Repo de Valores Overnight** por S/ 1 500 millones a una tasa de interés promedio de 2,93% (10:05 am).

La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,00%.

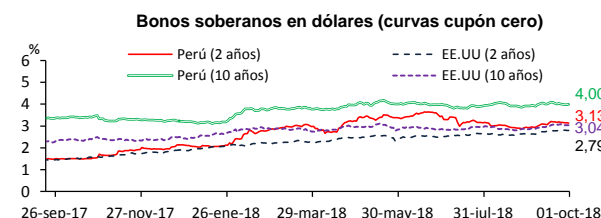
**Tasa de inflación anual Lima Metropolitana:** setiembre 1,28%.

La **probabilidad de incremento de la tasa de la Reserva Federal** según Bloomberg para la reunión del 08/11/2018 es de 2,0%.



\* CD Reajustable en función del tipo de cambio  
Fuente: BCRP

\* La información de este reporte no expresa la opinión del Ministerio de Economía y Finanzas.



Fuente: BCRP, Bloomberg

## PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

### CURVAS DE RENDIMIENTO

#### En EEUU:

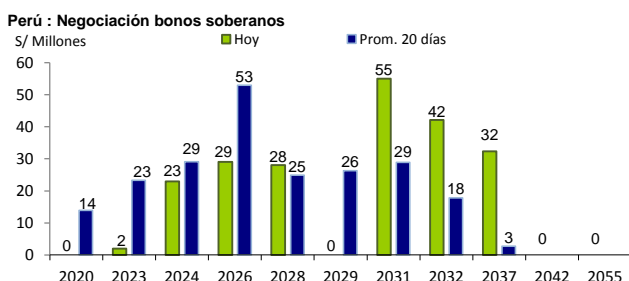
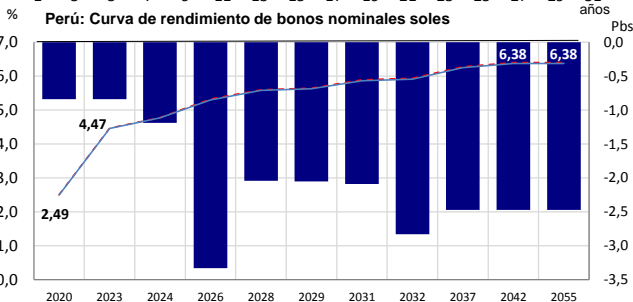
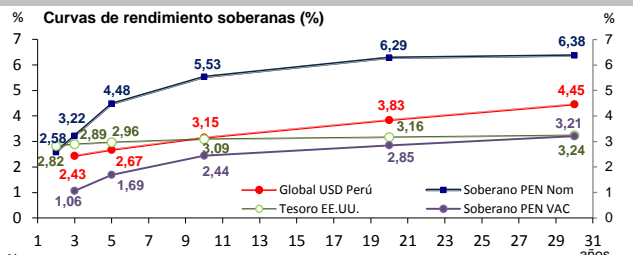
La curva de rendimiento del Tesoro subió 1,7 pb en promedio con respecto a la jornada por un mayor apetito al riesgo por parte de los inversores.

#### En Perú:

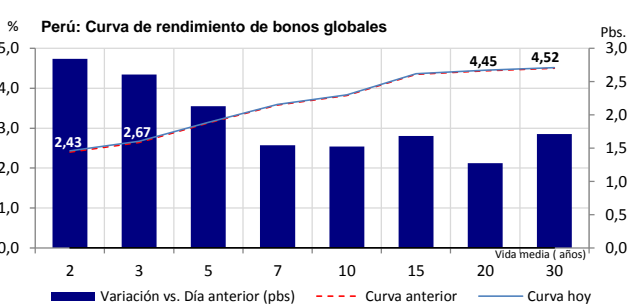
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 211,46 millones. Datatec informó por posición de compra S/ 135,15 millones, venta S/ 21,00 millones y operaciones de registro S/ 55,31 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles bajó -2,1 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares subió 1,9 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

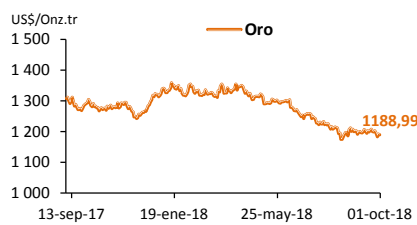
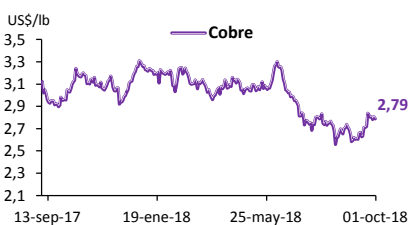
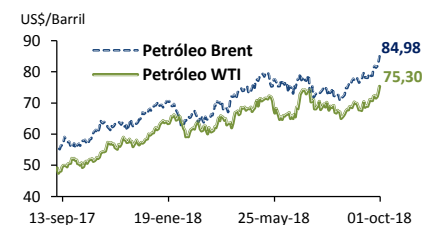


### MATERIAS PRIMAS

#### Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	75,30	2,050	2,80%
Brent	84,98	2,260	2,73%
Cobre	2,79	-0,018	-0,62%
Oro	1188,99	-1,890	-0,16%
Plata	14,49	-0,166	-1,14%

El precio del crudo WTI subió a US\$ 75,30/bbl debido a que inversores consideraron inminente la entrada en vigencia de las sanciones de Estados Unidos contra Irán, que busca el recorte de las exportaciones del petróleo crudo. Así también, el acuerdo entre EEUU y Canadá para rescatar el TLCAN (un pacto trilateral con México), impulsó el incremento de los precios del crudo WTI por mayores perspectivas de crecimiento.



Fuente: Bloomberg

### Indicadores económicos de hoy

En EEUU, el indicador PMI de fabricación Markit (Sep F) se mantuvo en 55,6 (consenso y anterior 55,6), el Gasto en construcción m/m (Ago) permaneció en 0,1% (consenso 0,4% anterior 0,1%), el ISM manufacturero (Sep) se redujo a 59,8 (consenso 60,0 anterior 61,3). Asimismo en la Eurozona, el indicador PMI de fabricación Markit (Sep F) disminuyó levemente a 53,2 (consenso y anterior 53,3), la tasa de desempleo (Ago) se redujo a 8,1% (consenso 8,1% anterior 8,2%). Por otro lado en Perú, CPI m/m y a/a se incrementaron a 0,19% y 1,28%, respectivamente (consenso 0,25% y 1,20%; anterior 0,13% y 1,07%).

### Calendario económico para el día martes, 02 de octubre de 2018 (hora de Lima)

#### Japón:

07:30 p.m.: PMI Nikkei servicios (Sep) (anterior 51,5).

07:30 p.m.: PMI Nikkei composite (Sep) (anterior 52,0).