



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3228 soles 0,010 0,30%

3 de octubre de 2018

Dow Jones: 26828,39 54,45 0,20%
Última actualización 03/10/2018 17:28

CONTEXTO DE HOY*

En la sesión, el dólar se apreció a nivel global y la curva de rendimiento del Tesoro de EEUU subió 8,9 pb en promedio debido a un mayor apetito por activos de riesgo de mercados desarrollados y venta de activos de mercados emergentes. Asimismo, el rendimiento del USTN 10Y subió a máximos de varios años 3,183% (anterior 3,064%), luego de que se publicaran datos que la economía de EEUU se mantuvo sólida en septiembre.

En el plano local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles subió 5 pb en promedio debido a una mayor oferta de bonos locales y bajos volúmenes de negociación. El monto negociado ascendió a S/ 142,24 millones según Datatec, de los cuales, se compraron S/ 35 millones, vendieron S/ 65,24 millones y se transaron S/ 42 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2024 (S/ 47 millones) y 2031 (S/ 28,24 millones).

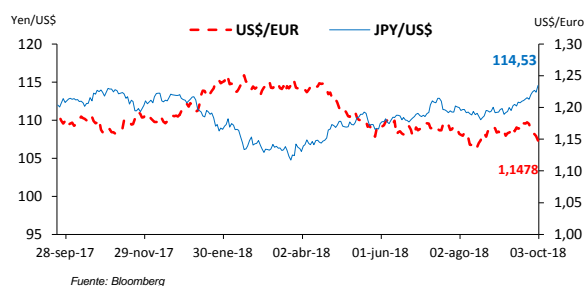
Por otro lado, el sol se depreció en la jornada en línea con las divisas de la región, en medio de la fortaleza global del dólar tras la publicación de datos positivos de empleo en EEUU. Según Reuters, se negociaron USD 305 millones en el mercado cambiario local.

DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var. %	Estado
Dólar (BBDXY)	1191,26	0,44	aprecia
Dólar (DXY)	95,76	0,27	aprecia
Euro	1,1478	-0,61	deprecia
Libra esterlina	1,2940	-0,30	deprecia
Yen	114,53	0,77	deprecia
Yuan	6,869	0,00	sin variación
Sol	3,3228	0,30	deprecia

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

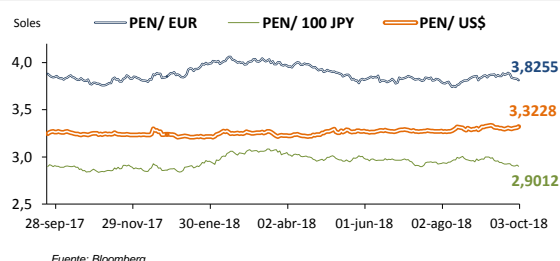


Fuente: Bloomberg

El **sol** se depreció en la jornada en línea con las divisas de la región, en medio de la fortaleza global del dólar tras la publicación de datos positivos de empleo en EEUU.

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

Desde inicios del año 2018, la moneda nacional se ha depreciado **2,63%**.



Fuente: Bloomberg

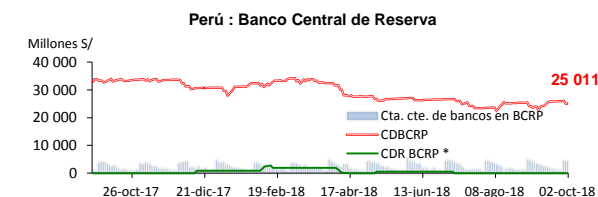
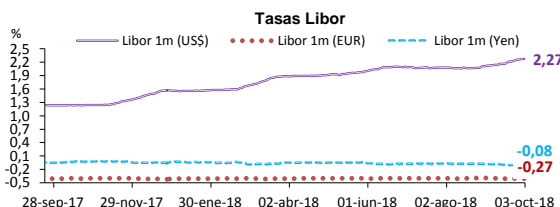
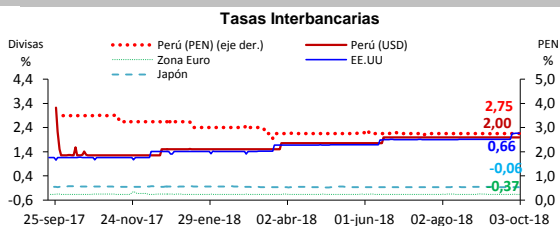
LIQUIDEZ

El **BCRP** colocó **CD BCRP a 18 meses** por S/ 50 millones a una tasa de interés promedio de 2,90% (11:05 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%.

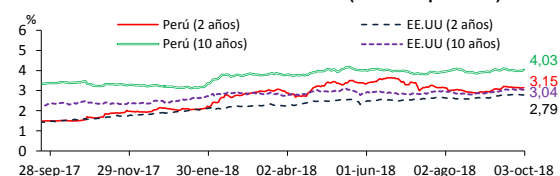
La **probabilidad de incremento de la tasa de la Reserva Federal** según Bloomberg para la reunión del 08/11/2018 es de 3,4%.



* 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.

Bonos soberanos en dólares (curvas cupón cero)



Fuente: BCRP, Bloomberg



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

CURVAS DE RENDIMIENTO

En EEUU:

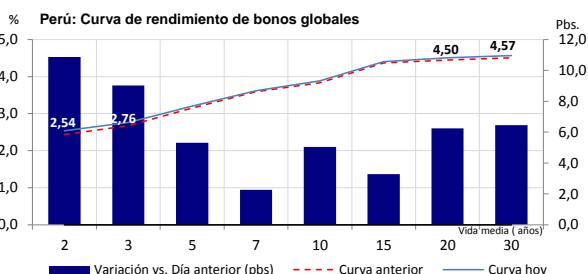
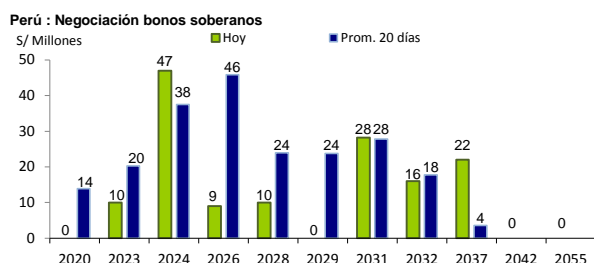
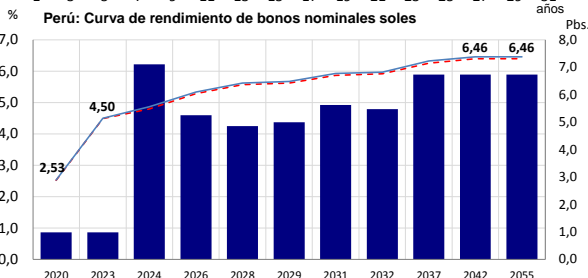
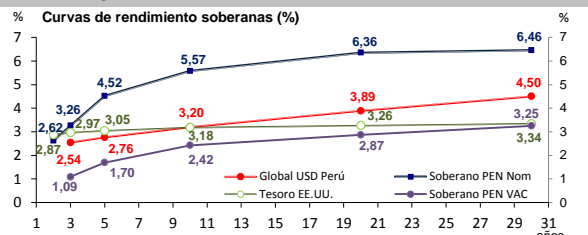
La curva de rendimiento del Tesoro subió 8,9 pb en promedio con respecto a la jornada por un mayor apetito al riesgo por renta variable en mercados desarrollados.

En Perú:

Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 142,24 millones. Datatec informó por posición de compra S/ 35 millones, venta S/ 65,24 millones y operaciones de registro S/ 42 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles subió 5 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares subió en 6,1 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



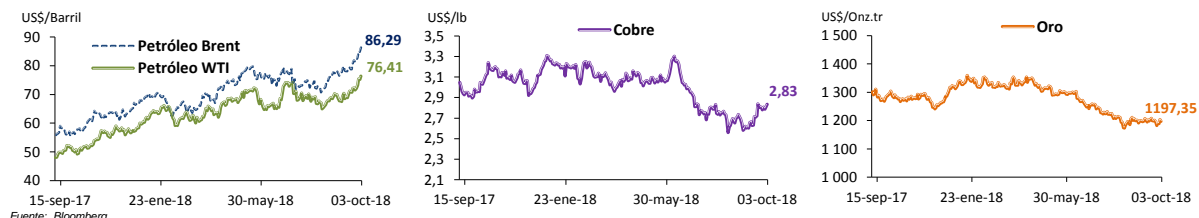
Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	76,41	1,180	1,57%
Brent	86,29	1,490	1,76%
Cobre	2,83	0,027	0,98%
Oro	1197,35	-5,970	-0,50%
Plata	14,64	-0,056	-0,38%

El precio del crudo WTI subió a US\$ 76,41/bbl impulsado por la perspectiva de un déficit en el suministro mundial una vez que las sanciones de EEUU contra Irán entren en vigencia.



Fuente: Bloomberg

Indicadores económicos de hoy

EEUU, el cambio en el número de empleos de ADP (set) incrementó a 230k (consenso 184k anterior 168k), el PMI no manufacturero de ISM (set) subió a 61,6 (consenso 58 anterior 58,5), los PMI servicios y compuesto de Markit (set) subieron a 53,5 (consenso 53 anterior 52,9) y 53,9 (anterior 53,4).

Calendario económico para el día jueves, 04 de octubre de 2018 (hora de Lima)

EEUU:

- 07:30 a.m.: Peticiones semanales de desempleo (29 set) (consenso 215k anterior 214k).
- 07:30 a.m.: Peticiones semanales de desempleo continuadas (22 set) (consenso 1665k anterior 1661k).
- 09:00 a.m.: Pedidos de fábrica (ago) (consenso 2,1% anterior -0,8%).
- 09:00 a.m.: Órdenes de bienes duraderos (ago) (consenso y anterior 4,5%).
- 09:00 a.m.: Órdenes de bienes de capital excluyendo sector aéreo (ago) (anterior -0,5%).