

PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3243 soles -0,003 -0,10%

5 de octubre de 2018

Dow Jones: 26447,05 -180,43 -0,68%
 Última actualización 05/10/2018 17:34

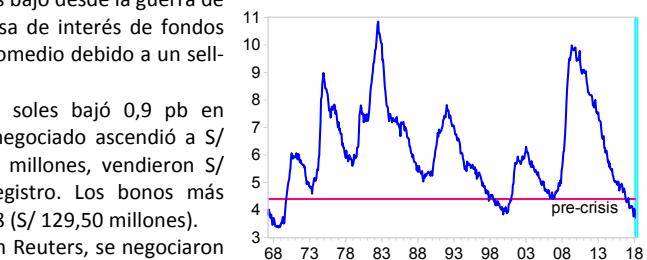
CONTEXTO DE HOY*

En la sesión, el rendimiento del USTN 10 años continuó subiendo a 3,234% (anterior 3,188%) luego que la tasa de desempleo de EEUU bajó a 3,7% (anterior 3,9%), el nivel más bajo desde la guerra de Vietnam, lo que se espera abra el camino para elevar nuevamente la tasa de interés de fondos federales. La curva de rendimiento del Tesoro de EEUU subió 3,5 pb en promedio debido a un sell-off global. Asimismo, el dólar se depreció a nivel global.

En el plano local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles bajó 0,9 pb en promedio debido a una mayor demanda de bonos locales. El monto negociado ascendió a S/ 359,68 millones según Data tec, de los cuales, se compraron S/ 193,18 millones, vendieron S/ 114,50 millones y se transaron S/ 52 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2026 (S/ 144,37 millones) y 2028 (S/ 129,50 millones).

El sol se apreció en la jornada debido a la debilidad global del dólar. Según Reuters, se negociaron USD 487 millones en el mercado cambiario local.

EEUU: Tasa de Desempleo Oficial (U3)

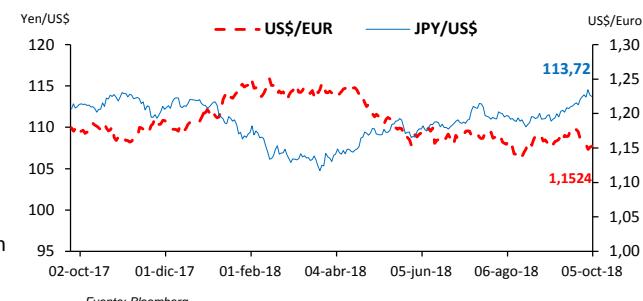


DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var.%	Estado
Dólar (BBDXY)	1189,81	-0,23	deprecia
Dólar (DXY)	95,62	-0,13	deprecia
Euro	1,1524	0,09	aprecia
Libra esterlina	1,3120	0,76	aprecia
Yen	113,72	-0,17	aprecia
Yuan	6,869	0,00	sin variación
Sol	3,3243	-0,10	aprecia

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

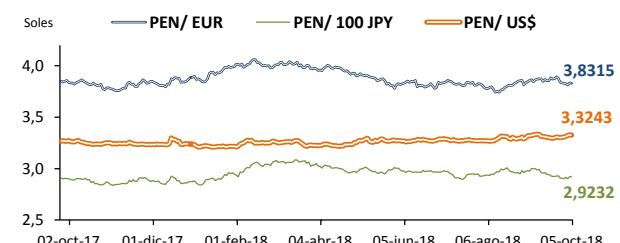


Fuente: Bloomberg

El **sol** se apreció en la jornada debido a la debilidad global del dólar luego de la publicación de datos económicos 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 **2,67%**.



Fuente: Bloomberg

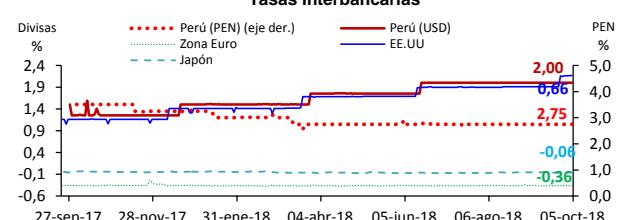
LÍQUIDEZ

El **BCRP** colocó **CD BCRP a 6 meses** por S/ 200 millones a una tasa de interés promedio de 2,63% (01:05 pm).

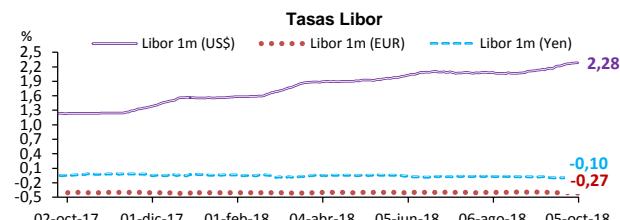
La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,00%.

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

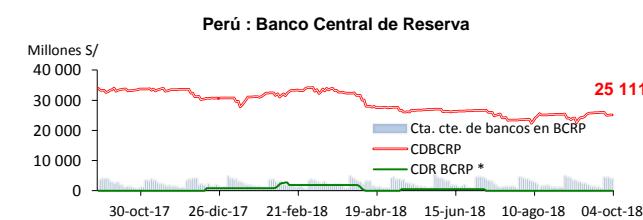
La **probabilidad de incremento de la tasa de la Reserva Federal** según Bloomberg para la reunión del 08/11/2018 es de 4,8%.



Tasas Interbancarias



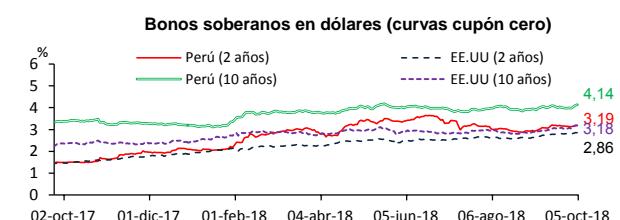
Tasas Libor



* 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



DIRECCIÓN DE ANÁLISIS Y ESTRATEGIA

DIRECCIÓN GENERAL DE ENDEUDAMIENTO Y TESORO PÚBLICO

MINISTERIO DE ECONOMÍA Y FINANZAS DEL PERÚ

PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

CURVAS DE RENDIMIENTO

En EEUU:

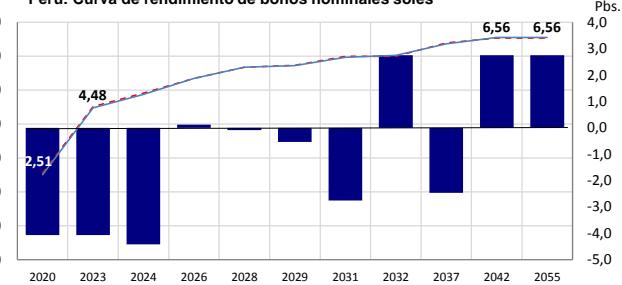
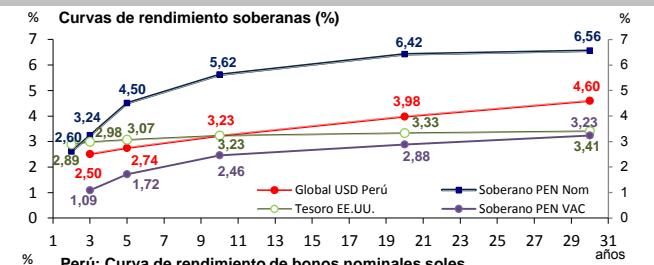
La curva de rendimiento del Tesoro subió 3,5 pb en promedio con respecto a la jornada anterior a pesar de un menor apetito al riesgo por renta variable.

En Perú:

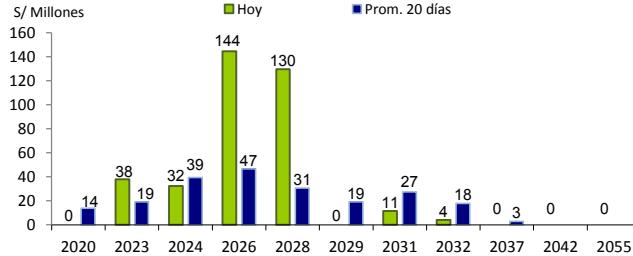
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 359,68 millones. Data tec informó por posición de compra S/ 193,18 millones, venta S/ 114,50 millones y operaciones de registro S/ 52 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles bajó 0,9 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares subió en 2,3 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



Perú : Negociación bonos soberanos



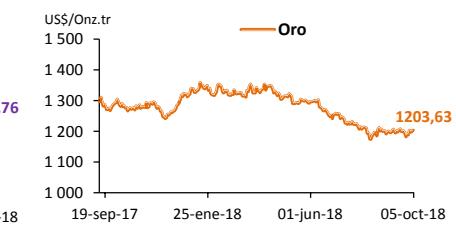
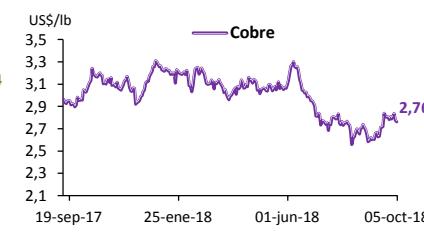
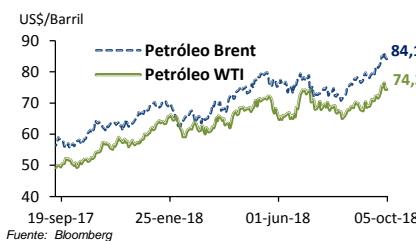
Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	74,34	0,010	0,01%
Brent	84,16	-0,420	-0,50%
Cobre	2,76	-0,015	-0,52%
Oro	1203,63	3,710	0,31%
Plata	14,63	0,039	0,27%

El precio del crudo WTI subió ligeramente a US\$ 74,34/bbl debido a que Arabia Saudita y Rusia afirmaron que los aumentos de precios de esta semana aumentarían la producción para, al menos en parte, compensar las interrupciones previstas de Irán.



Indicadores económicos de hoy

EEUU, la balanza comercial (ago) bajó a -\$53,2b (consenso -\$53,6b anterior -\$50b), el cambio en las nóminas no agrícolas (set) bajaron a 134k (consenso 185k anterior 270k), el cambio en las nóminas manufactureras (set) subieron a 18k (consenso 15k anterior 5k), la tasa de desempleo (set) se redujo a 3,7% (consenso 3,8% anterior 3,9%) y el salario por hora promedio (set) incrementó 2,8% anual y 0,3% mensual (Var.% anual y mensual: consenso 2,8% y 0,3% anterior 2,9% y 0,3%).

Calendario económico para el día martes, 09 de octubre de 2018 (hora de Lima)

EEUU:

05:00 a.m.: Índice de optimismo de pequeñas empresas del NFIB (set) (consenso y anterior 108,8).

China:

07/10/18 08:45 p.m.: PMI servicios de Caixin/Markit (set) (consenso 51,4 anterior 51,5).

07/10/18 08:45 p.m.: PMI compuesto de Caixin/Markit (set) (anterior 52).