



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3253 soles 0,002 0,05%

9 de octubre de 2018

Dow Jones: 26430,57 -56,21 -0,21%
Última actualización 09/10/2018 18:13

CONTEXTO DE HOY*

En la sesión, los mercados en EEUU cerraron mixtos, la curva de rendimiento del Tesoro de EEUU bajó 1,2 pb en promedio debido a un menor apetito al riesgo por preocupaciones sobre el aumento de los costos y la desaceleración del crecimiento mundial. Por otro lado, el rendimiento del USTN 10Y bajó a 3,207% (anterior 3,234%) y el dólar se depreció a nivel global.

En el plano local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles bajó 1,9 pb en promedio debido a una mayor demanda de bonos locales. El monto negociado ascendió a S/ 216,81 millones según Datatec, de los cuales, se compraron S/ 116,05 millones, vendieron S/ 24,65 millones y se transaron S/ 76,1 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2032 (S/ 54,65 millones) y 2028 (S/ 39 millones).

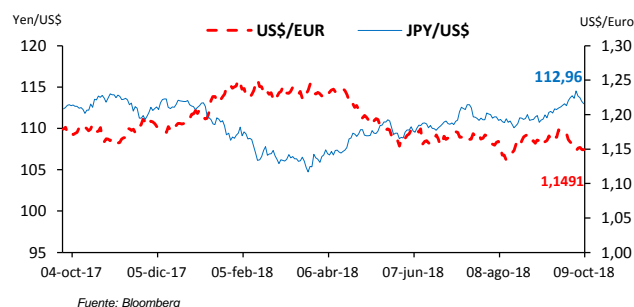
Por otro lado, el sol cerró con pocos cambios en la jornada en medio de un incremento en las tensiones comerciales globales y luego de que el Fondo Monetario Internacional redujera sus expectativas de crecimiento. Según Reuters, se negociaron USD 494 millones en el mercado cambiario local.

DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var. %	Estado
Dólar (BBDXY)	1189,83	-0,06	deprecia
Dólar (DXY)	95,67	-0,10	deprecia
Euro	1,1491	-0,01	deprecia
Libra esterlina	1,3143	0,40	aprecia
Yen	112,96	-0,24	aprecia
Yuan	6,923	-0,12	aprecia
Sol	3,3253	0,05	deprecia

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

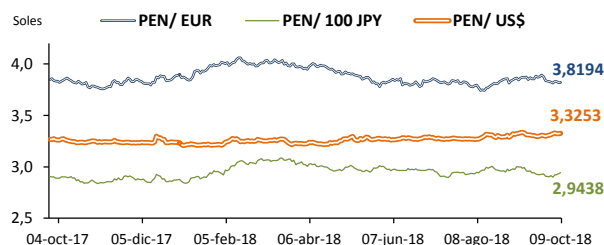


Fuente: Bloomberg

El **sol** se depreció ligeramente en la jornada en medio de un incremento en las tensiones comerciales globales y luego de que el Fondo Monetario Internacional redujera sus expectativas de crecimiento.

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

Desde inicios del año 2018, la moneda nacional se ha depreciado **2,70%**.



Fuente: Bloomberg

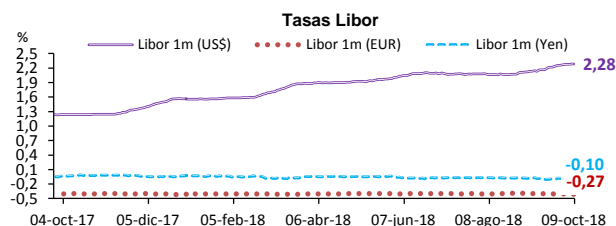
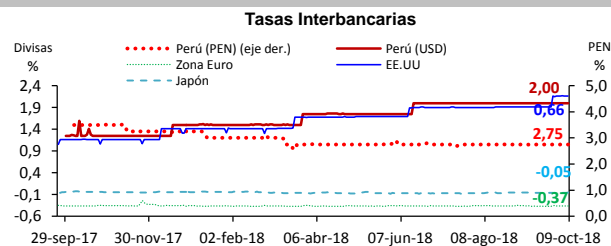
LIQUIDEZ

El **BCRP** colocó **DP BCRP Overnight** por S/ 1 000 millones a una tasa de interés promedio de 2,32% (01:35 pm) y **CD BCRP a 6 meses** por S/ 300 millones a una tasa de interés promedio de 2,62% (01:20 pm).

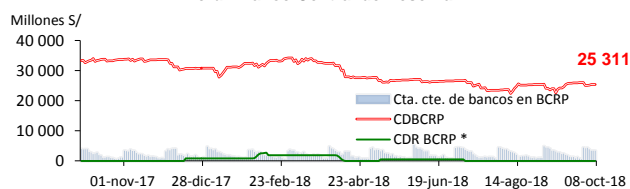
La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,00%.

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 1,3%.



Perú : Banco Central de Reserva

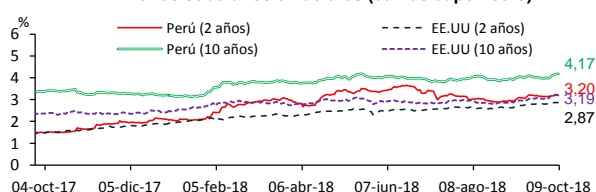


* CD Reajustable en función del tipo de cambio

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:

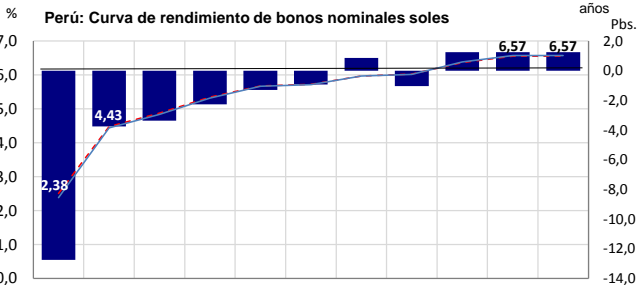
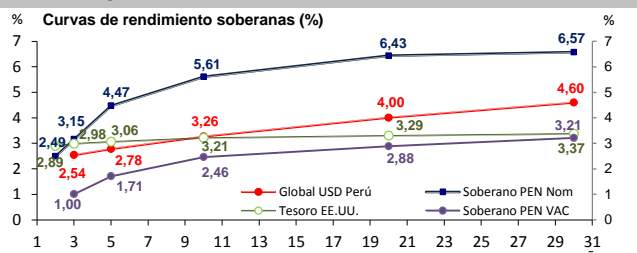
La curva de rendimiento del Tesoro bajó 1,2 pb en promedio con respecto a la jornada anterior debido a un menor apetito al riesgo por renta variable.

En Perú:

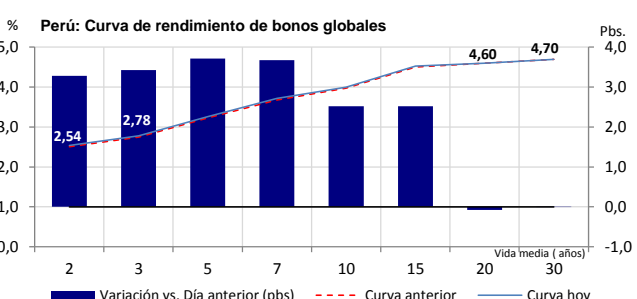
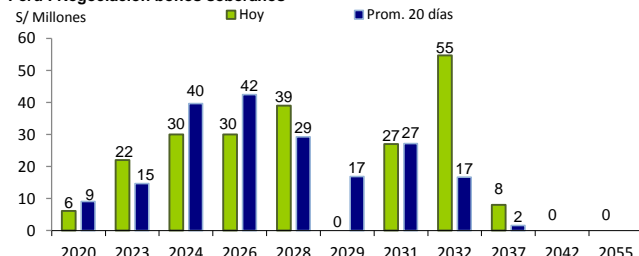
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 216,81 millones. Datatec informó por posición de compra S/ 116,05 millones, venta S/ 24,65 millones y operaciones de registro S/ 76,10 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles bajó 1,9 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares subió en 2,4 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



Perú: Negociación bonos soberanos



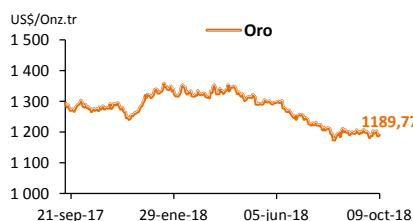
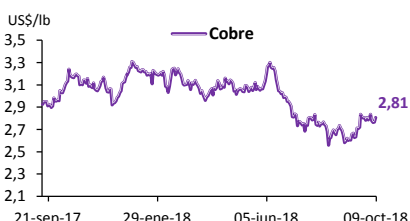
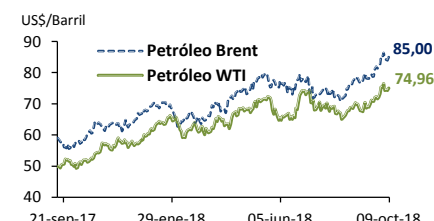
Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	74,96	0,670	0,90%
Brent	85,00	1,090	1,30%
Cobre	2,81	0,039	1,43%
Oro	1189,77	1,690	0,14%
Plata	14,39	0,015	0,10%

El precio del crudo WTI subió a US\$ 74,96/bbl debido a la expectativa de la caída de exportaciones de crudo iraní antes de la imposición de nuevas sanciones estadounidenses, así como por un cierre parcial de la producción en el Golfo de México debido al huracán Michael.



Fuente: Bloomberg

Indicadores económicos de hoy

EEUU, el índice de optimismo de pequeñas empresas del NFIB (set) bajó a 108,8 (consenso y anterior 108,8).

Calendario económico para el día miércoles, 10 de octubre de 2018 (hora de Lima)

EEUU:

- 06:00 a.m.: Solicitudes de hipotecas del MBA (05 oct) (anterior 0%).
- 07:30 a.m.: IPP de demanda final (set) (Var.% anual y mensual: consenso 2,7% y 0,2% anterior 2,8% y -0,1%).
- 07:30 a.m.: IPP subyacente (set) (Var.% anual y mensual: consenso 2,5% y 0,2% anterior 2,3% y 0,1%).
- 09:00 a.m.: Inventarios al por mayor (ago) (Var.% mensual: consenso y anterior 0,8%).