



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3345 soles 0,007 0,22%

12 de octubre de 2018

Dow Jones: 25339,99 287,16 1,15%
 Última actualización 12/10/2018 16:34

CONTEXTO DE HOY*

En la sesión, los mercados en EEUU se recuperaron y cerraron con ganancias luego que sólidas exportaciones chinas calmaron algunas preocupaciones sobre el crecimiento económico chino y el efecto de la guerra comercial con EEUU.

En ese contexto, la curva de rendimiento del Tesoro de EEUU subió 1,2 pb en promedio debido a una mayor demanda de activo de riesgo. Por otro lado, el rendimiento del USTN 10Y subió a 3,162% (anterior 3,151%) y el dólar se apreció a nivel global.

En el plano local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles subió 1,3 pb en promedio debido a una mayor oferta de bonos locales. El monto negociado ascendió a S/ 379,07 millones según Data tec, de los cuales, se compraron S/ 102,16 millones, vendieron S/ 222,92 millones y se transaron S/ 54 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2023 (S/ 156,20 millones) y 2028 (S/ 85,71 millones).

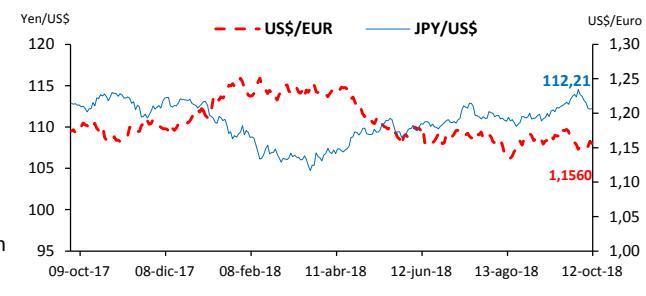
Por otro lado, el sol se depreció en la jornada debido a una mayor demanda de ME por parte de inversores extranjeros para coberturas en medio de un alza global del dólar. Según Reuters, se negociaron USD 564 millones en el mercado cambiario local.

DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var.%	Estado
Dólar (BBDXY)	1186,20	0,12	aprecia
Dólar (DXY)	95,26	0,25	aprecia
Euro	1,1560	-0,28	deprecia
Libra esterlina	1,3153	-0,58	deprecia
Yen	112,21	0,04	deprecia
Yuan	6,922	0,47	deprecia
Sol	3,3345	0,22	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.

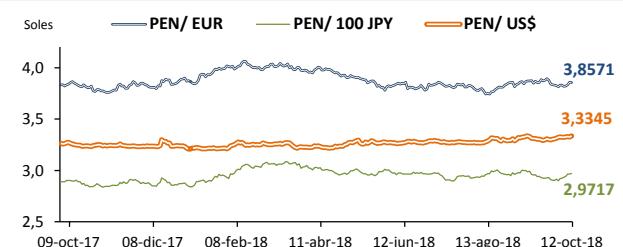


Fuente: Bloomberg

El **sol** se depreció en la jornada debido a una mayor demanda de ME por parte de inversores extranjeros para coberturas en medio de un alza global del dólar.

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

Desde inicios del año 2018, la moneda nacional se ha depreciado **2,99%**.



Fuente: Bloomberg

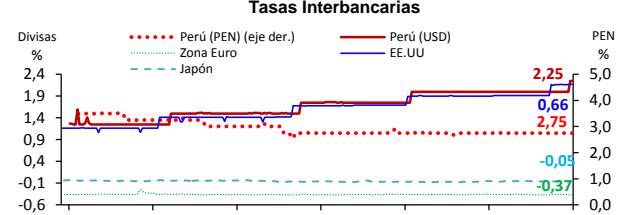
LÍQUIDEZ

El **BCRP** colocó **DP BCRP Overnight** por S/ 650 millones a una tasa de interés promedio de 2,32% (01:35 pm) y **DP BCRP Overnight** por S/ 1 000 millones a una tasa de interés promedio de 2,32% (10:05 am).

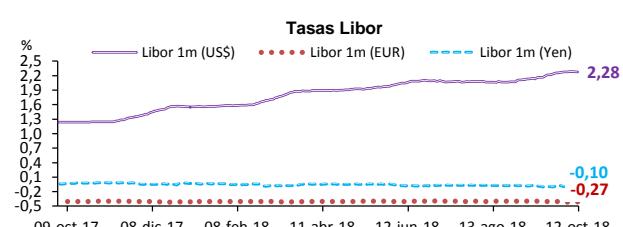
La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,00%.

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%.

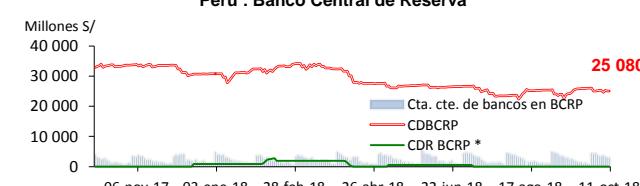


Tasas Interbancarias



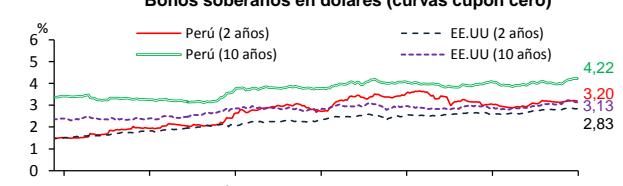
Tasas Libor

Perú : Banco Central de Reserva



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

Bonos soberanos en dólares (curvas cupón cero)



* 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:

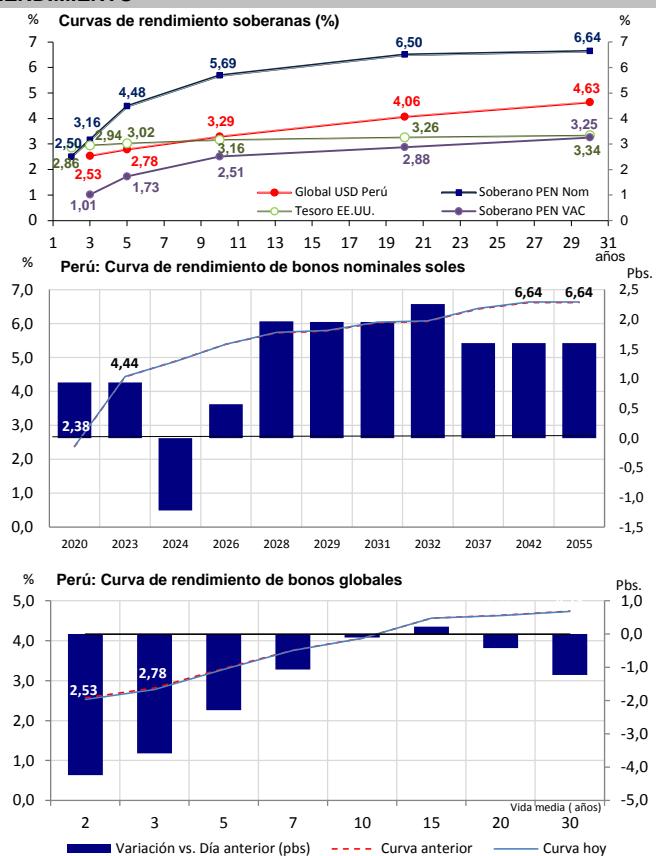
La curva de rendimiento del Tesoro subió 1,2 pb en promedio con respecto a la jornada anterior debido a un mayor apetito al riesgo por renta variable.

En Perú:

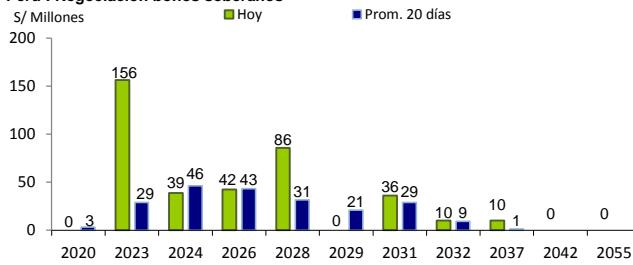
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 379,07 millones. Datafec informó por posición de compra S/ 102,16 millones, venta S/ 222,92 millones y operaciones de registro S/ 54 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles subió 1,3 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

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



Perú : Negociación bonos soberanos



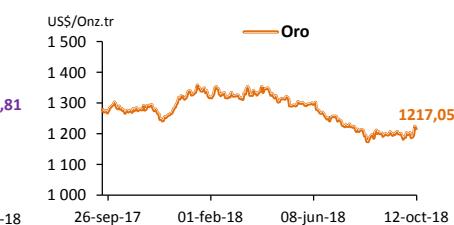
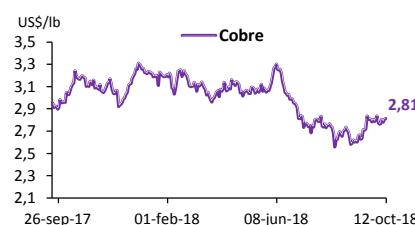
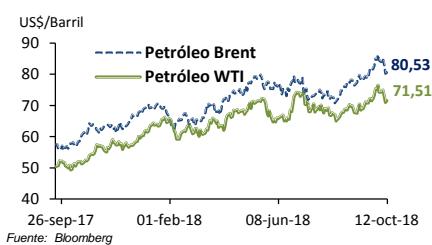
Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	71,51	0,540	0,76%
Brent	80,53	0,270	0,34%
Cobre	2,81	0,009	0,32%
Oro	1217,05	-7,040	-0,58%
Plata	14,58	-0,005	-0,03%

El precio del crudo WTI subió a US\$ 71,51/bbl debido a que la Agencia Internacional de Energía (IEA) consideró que la oferta mundial de crudo era adecuada y que el panorama para la demanda estaba débil.



Indicadores económicos de hoy

EEUU, el índice de precios de importación (set) incrementó 0,5% (consenso 0,2% anterior -0,4%) y el índice de sentimiento del consumidor de la Universidad de Michigan (oct prel) bajó a 99 (consenso 100,5 anterior 100,1).

Calendario económico para el día lunes, 15 de octubre de 2018 (hora de Lima)

EEUU:

07:30 a.m.: Ventas al por menor anticipadas (set) (Var.% mensual: consenso 0,7% anterior 0,1%).

07:30 a.m.: Índice de condiciones de negocios Empire State de manufactura de la Fed de Nueva York (oct) (consenso 20,5 anterior 19).

China:

08:30 p.m.: IPP (set) (Var.% anual: consenso 3,6% mensual anterior 4,1%).

08:30 p.m.: IPC (set) (Var.% anual: consenso 2,5% anterior 2,3%).

Japón:

04:00 a.m.: Producción industrial (ago) (Var.% anual y mensual: anterior 0,6% y 0,7%).