



DIRECCIÓN DE ANÁLISIS Y ESTRATEGIA

DIRECCIÓN GENERAL DE ENDEUDAMIENTO Y TESORO PÚBLICO

MINISTERIO DE ECONOMÍA Y FINANZAS DEL PERÚ

## PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3353 soles 0,001 0,02%

15 de octubre de 2018

Dow Jones: 25250,55 -89,44 -0,35%

Última actualización 15/10/2018 18:00

## CONTEXTO DE HOY\*

En la sesión, las tensiones comerciales globales y geopolíticas con China conllevaron a mayores preocupaciones sobre el crecimiento global por parte de los inversores. En ese contexto, la curva de rendimiento del Tesoro de EEUU subió 0,3 pb en promedio a pesar de una menor demanda de activos de refugio. Por otro lado, el rendimiento del USTN 10Y bajó a 3,157% (anterior 3,162%) y el dólar se depreció a nivel global.

En el plano local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles bajó -0,1 pb en promedio debido a una mayor demanda de bonos locales. El monto negociado ascendió a S/ 421,42 millones según Data tec, de los cuales, se compraron S/ 75,57 millones, vendieron S/ 73,85 millones y se transaron S/ 272 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2023 (S/ 262 millones) y 2024 (S/ 69,85 millones).

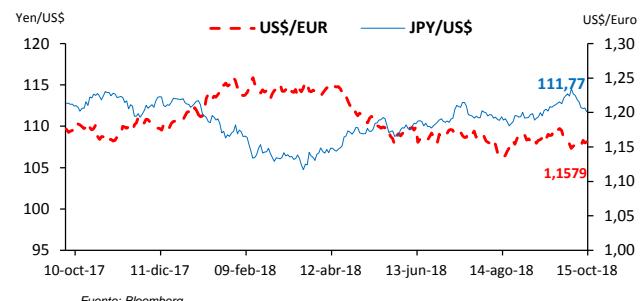
Por otro lado, el sol se depreció en la jornada debido a una mayor demanda de ME por parte de inversores extranjeros y bancos locales a pesar de que el BCRP colocó swaps cambiantos para mitigar la caída del sol. Según Reuters, se negociaron USD 428 millones en el mercado cambiario local.

## DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var.%	Estado
Dólar (BBDXY)	1183,84	-0,20	deprecia
Dólar (DXY)	95,06	-0,17	deprecia
Euro	1,1579	0,16	aprecia
Libra esterlina	1,3152	-0,01	deprecia
Yen	111,77	-0,39	aprecia
Yuan	6,917	-0,08	aprecia
Sol	3,3353	0,02	deprecia

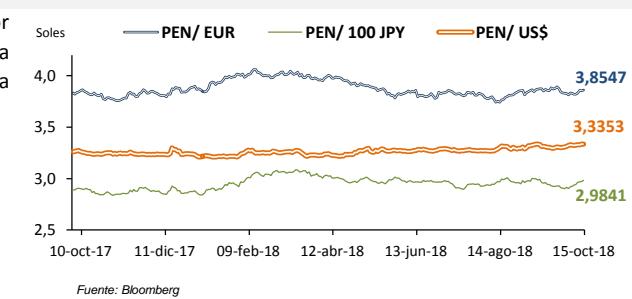
El **dólar BBDXY** se depreció a nivel global en medio de una apreciación del euro, el yen y algunas monedas emergentes.



El **sol** se depreció ligeramente en la jornada debido a una mayor demanda de ME por parte de inversores extranjeros y bancos locales a pesar de que el BCRP colocó swaps cambiantos para mitigar la caída de la moneda local.

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

Desde inicios del año 2018, la moneda nacional se ha depreciado **3,01%**.



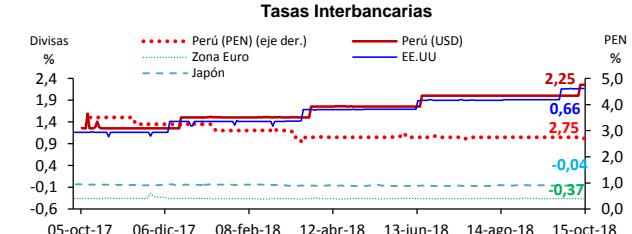
## LIQUIDEZ

El **BCRP** colocó **Swap Cambiario Venta** por S/ 85 millones a 2 meses a una tasa de interés promedio de 1,98% (01:30 pm), **Swap Cambiario Venta** por S/ 500 millones a 2 meses a una tasa de interés promedio de 1,54% (01:25 pm) y **DP BCRP Overnight** por S/ 1 000 millones a una tasa de interés promedio de 2,34% (10:05 am).

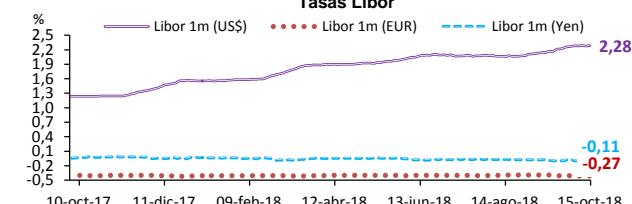
La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,25%.

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

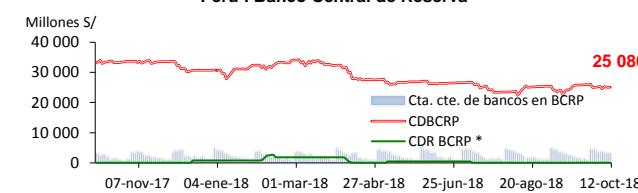
La **probabilidad de incremento de la tasa de la Reserva Federal** según Bloomberg para la reunión del 08/11/2018 es de 2%.



## Tasas Libor

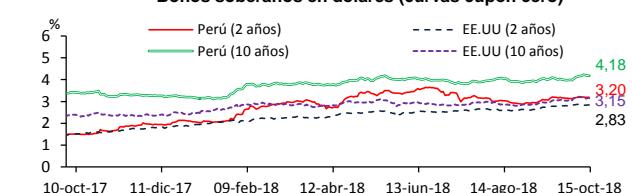


## Perú : Banco Central de Reserva



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

## Bonos soberanos en dólares (curvas cupón cero)



## PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

### CURVAS DE RENDIMIENTO

En EEUU:

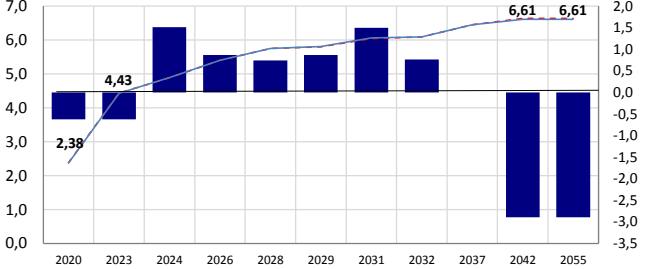
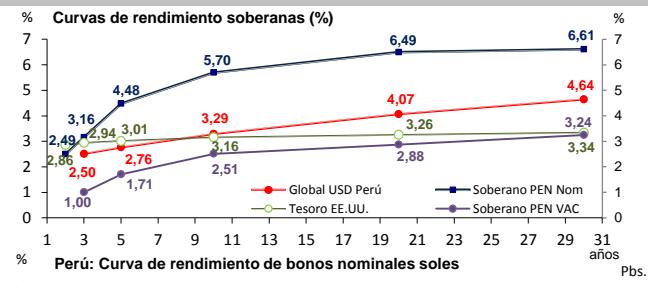
**La curva de rendimiento del Tesoro** subió 0,3 pb en promedio con respecto a la jornada anterior a pesar de un menor apetito al riesgo por renta variable.

En Perú:

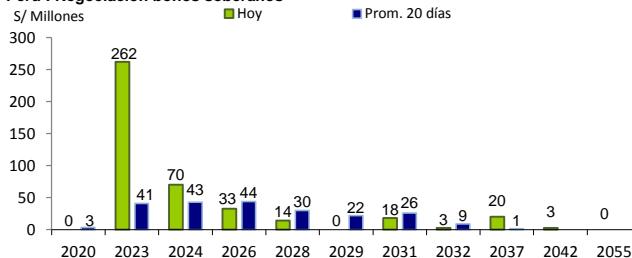
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 421,42 millones. Data tec informó por posición de compra S/ 75,57 millones, venta S/ 73,85 millones y operaciones de registro S/ 272 millones.

**La curva de rendimiento soberana en soles** bajó 0,1 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

**La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares** subió en 0,1 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



### Perú : Negociación bonos soberanos



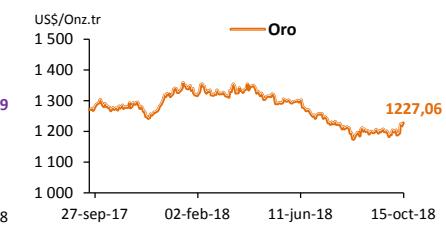
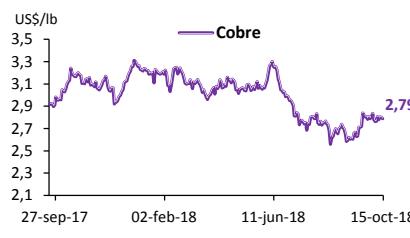
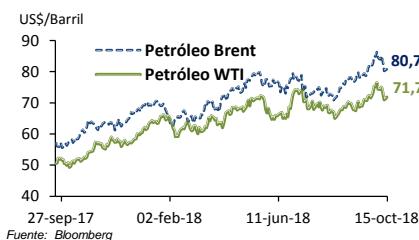
Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

### MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	71,78	0,440	0,62%
Brent	80,78	0,350	0,44%
Cobre	2,79	-0,012	-0,43%
Oro	1227,06	10,010	0,82%
Plata	14,69	0,115	0,79%

**El precio del crudo WTI** subió a US\$ 71,78/bbl debido a la tensión geopolítica por la desaparición de un periodista saudí que ha despertado las preocupaciones sobre los suministros de Riadh.



### Indicadores económicos de hoy

**EEUU**, las ventas al por menor anticipadas (set) incrementó 0,1% (consenso 0,6% anterior 0,1%), el Índice de condiciones de negocios Empire State de manufactura de la Fed de Nueva York (oct) subió a 21,1 (consenso 20,5 anterior 19). **Perú**, el PBI (ago) creció 2,25% (anterior 2,31%).

### Calendario económico para el día martes, 16 de octubre de 2018 (hora de Lima)

**EEUU:**

- 08:15 a.m.: Producción industrial (set) (Var.% mensual: consenso 0,2% anterior 0,4%).
- 08:15 a.m.: Utilización de capacidad (set) (consenso 78,2% anterior 78,1%).
- 05:00 a.m.: Índice de mercado de viviendas NAHB (oct) (consenso 66 anterior 67).

**Eurozona:**

- 4:00 a.m.: Balanza Comercial (ago) (anterior €17,6b).