

## PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3347 soles **-0,001** **-0,02%**

18 de octubre de 2018

Dow Jones: 25379,45 **-327,23** **-1,27%**

Última actualización 18/10/2018 17:51

### CONTEXTO DE HOY\*

En la sesión de hoy, ante un creciente temor por la posibilidad de que la Reserva Federal (Fed) siga elevando la tasa de referencia en los meses próximos, los inversionistas mostraron aversión al riesgo llevando a caídas de los índices bursátiles de EEUU. En ese contexto, la curva del Tesoro de EEUU disminuyó en 1,3 puntos básicos (pb) en promedio en la sesión. El rendimiento del USTN 10 años se redujo a 3,180% (anterior 3,206%) y el USTN 2 años bajó a 2,877% (anterior 2,890%). El dólar se apreció a nivel global en medio de una depreciación del euro, la libra esterlina y algunas monedas emergentes.

A nivel local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles se incrementó en 2,5 pb en promedio, debido a una mayor oferta de papeles por parte de clientes corporativos. La negociación de bonos soberanos en soles en la jornada ascendió a S/ 97,00 millones según Data tec, de los cuales se compraron S/ 3,00 millones, vendieron S/ 20,00 millones y se transaron S/ 74,00 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2028 (S/ 36,5 millones) y 2024 (S/ 27,0 millones).

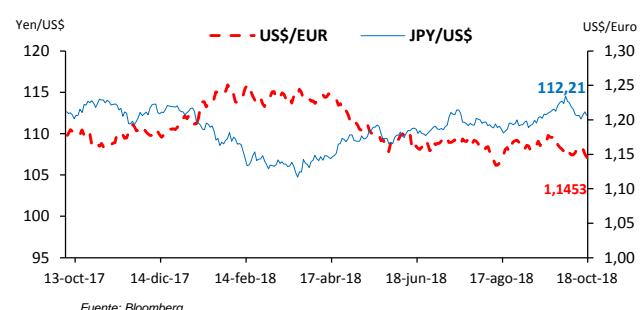
Por otro lado, el sol subió el jueves tras una jornada donde la moneda peruana revirtió sus pérdidas iniciales y cerró estable luego de una intervención del Banco Central con swaps cambiantos, que contrarrestó el avance del dólar en los mercados externos. Según Reuters, se negoció US\$ 387 millones en el mercado local en la sesión.

### DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var.%	Estado
Dólar (BBDXY)	1193,53	0,43	aprecia
Dólar (DXY)	95,90	0,34	aprecia
Euro	1,1453	-0,42	deprecia
Libra esterlina	1,3018	-0,74	deprecia
Yen	112,21	-0,39	aprecia
Yuan	6,938	0,15	deprecia
Sol	3,3347	-0,02	aprecia

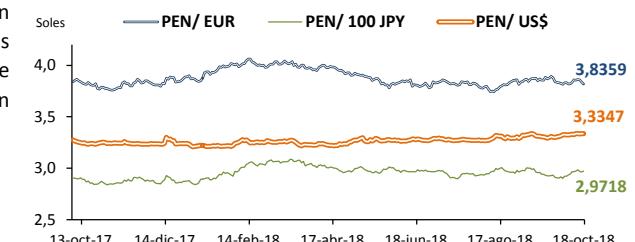
El **dólar BBDXY** se apreció a nivel global en medio de una depreciación del euro, la libra esterlina y algunas monedas emergentes.



El **sol** cerró estable luego de una intervención del Banco Central con swaps cambiantos, que contrarrestó el avance del dólar en los mercados externos. Las ofertas de dólares de las AFPs y empresas locales que requerían soles por un periodo de pago de impuestos, también ayudaron a revertir las pérdidas 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 **2,99%**.



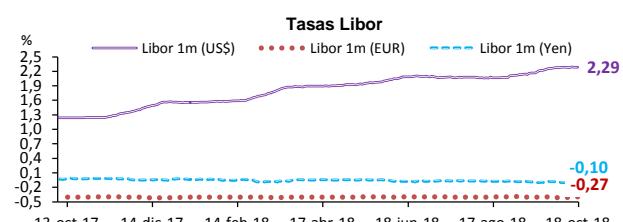
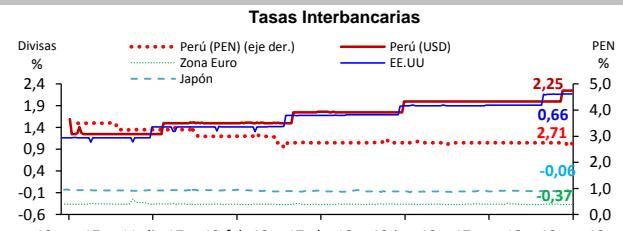
### LIQUIDEZ

El **BCRP** colocó **CD BCRP a 1 año** por S/ 50 millones a una tasa de interés promedio de 2,82% (11:05 am) y **Swap Cambiario Venta a 2 meses** por S/ 300 millones a una tasa de interés promedio de 1,75% (10:55 am).

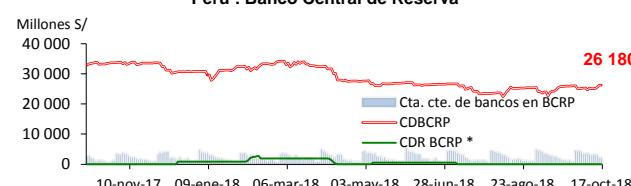
La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,25%.

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

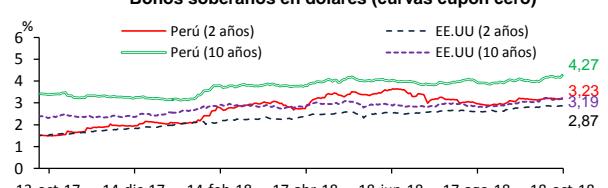
**La probabilidad de incremento de la tasa de la Reserva Federal** según Bloomberg para la reunión del 08/11/2018 es de 6,1%.



### Perú : Banco Central de Reserva



### Bonos soberanos en dólares (curvas cupón cero)



## PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

### CURVAS DE RENDIMIENTO

#### En EEUU:

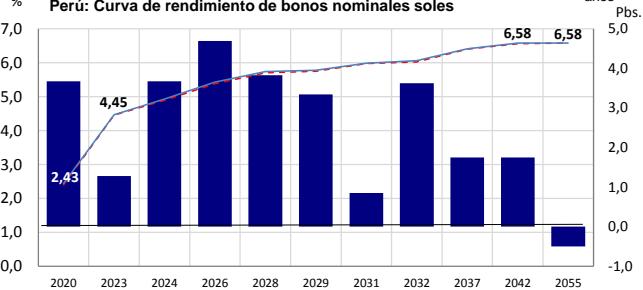
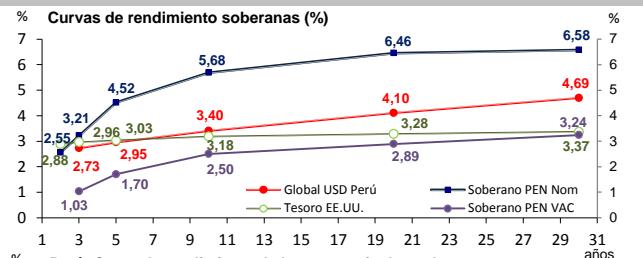
**La curva de rendimiento del Tesoro** bajó -1,3 pb en promedio con respecto a la jornada anterior por un menor apetito al riesgo por renta variable.

#### En Perú:

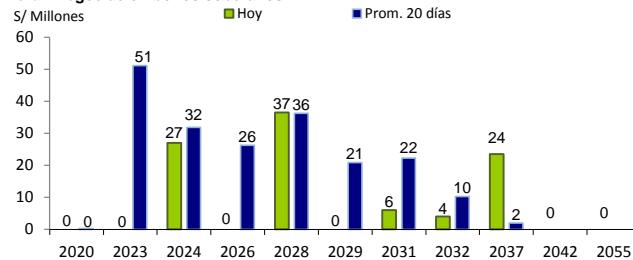
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 97,00 millones. Datafec informó por posición de compra S/ 3 millones, venta S/ 20 millones y operaciones de registro S/ 74 millones.

**La curva de rendimiento soberana en soles** subió 2,5 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

**La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares** subió en 8,4 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



#### Perú : Negociación bonos soberanos



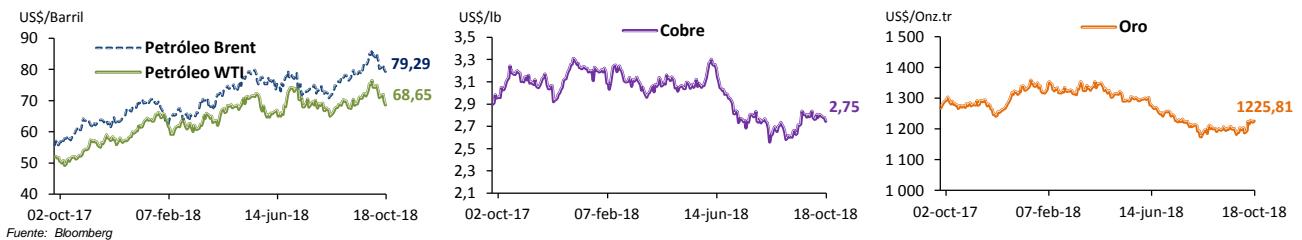
Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

### MATERIAS PRIMAS

#### Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	68,65	-1,100	-1,58%
Brent	79,29	-0,760	-0,95%
Cobre	2,75	-0,032	-1,13%
Oro	1225,81	3,520	0,29%
Plata	14,58	-0,034	-0,24%

**El precio del crudo WTI** cayó a US\$ 68,65/bbl al seguir viéndose afectado por un aumento de las reservas de petróleo mayor de lo esperado, que ascendieron de 6,5 millones hasta los 416,4 millones de barriles, según reportó el Departamento de Energía (DOE) el día de ayer.



### Indicadores económicos de hoy

**EEUU:** las peticiones iniciales de desempleo (13 Oct) se redujeron ligeramente a 210k (consenso 211k, anterior 215k), y el índice líder (Set) se incrementó a 0,5% (consenso 0,5%, anterior 0,4%).

### Calendario económico para el día viernes, 19 de octubre de 2018 (hora de Lima)

#### EEUU:

09:00 a.m.: Ventas de viviendas de segunda (sep) (consenso 5,29M anterior 5,34M).