



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3682 soles **-0,004** **-0,11%**

2 de enero de 2019

Dow Jones: 23346,24 18,78 0,08%

Última actualización 02/01/2019 18:20

CONTEXTO DE HOY*

En la sesión de hoy, los principales mercados bursátiles de EEUU cerraron al alza, en una jornada marcada por la volatilidad y el buen desempeño de los valores bancarios, tecnológicos y del sector energético; asimismo, los datos de actividad manufacturera en China y la Eurozona marcaron las preocupaciones de los inversionistas. En ese contexto, la curva del Tesoro de EEUU se redujo en 3,9 puntos básicos (pb) en promedio en la sesión. El rendimiento del USTN 10 años se redujo a 2,621% (anterior 2,685%) y el USTN 2 años disminuyó a 2,470% (anterior 2,490%). El dólar se apreció a nivel global frente a una cesta de monedas, frente a la depreciación del euro y la libra esterlina.

A nivel local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles se incrementó en 0,1 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/ 650,59 millones según Data tec, de los cuales se compraron S/ 226,59 millones, vendieron S/ 210,00 millones y se transaron S/ 214,00 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2026 (S/ 217,5 millones) y 2029 (S/ 142,0 millones).

Por otro lado, el sol se apreció 0,11% en una jornada donde la demanda de bancos e inversores extranjeros compensó la oferta de empresas y administradoras de fondos de pensiones. Según Reuters, se negoció US\$ 275 millones en el mercado local en la sesión.

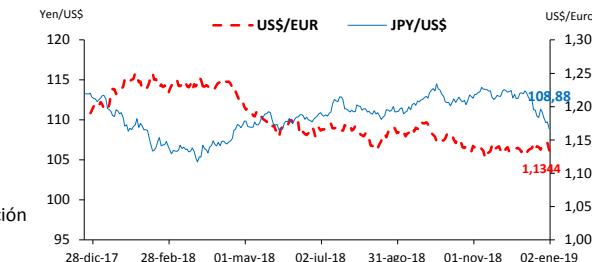
* La información del contexto no expresa la opinión del Ministerio de Economía y Finanzas.

DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var. %	Estado
Dólar (BBDXY)	1199,79	0,34	aprecia
Dólar (DXY)	96,56	0,50	aprecia
Euro	1,1344	-1,06	deprecia
Libra esterlina	1,2607	-1,04	deprecia
Yen	108,88	-0,78	aprecia
Yuan	6,862	-0,24	aprecia
Sol	3,3682	-0,11	aprecia

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

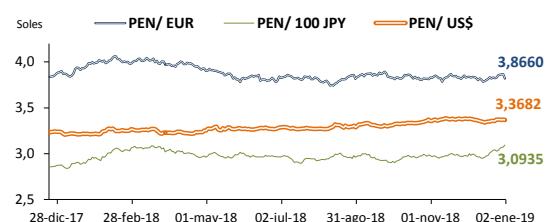


Fuente: Bloomberg

El sol se apreció en 0,11% (S/3,368 por dólar) luego de que una oferta de dólares de empresas y de administradoras de fondos de pensiones compensaron una demanda inicial de divisas de bancos y de inversores extranjeros.

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

Desde inicios del año 2019, la moneda nacional se ha apreciado **0,11%**.



Fuente: Bloomberg

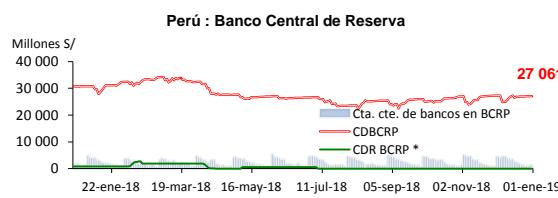
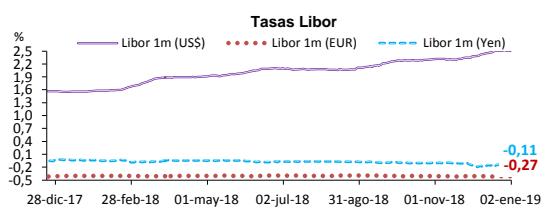
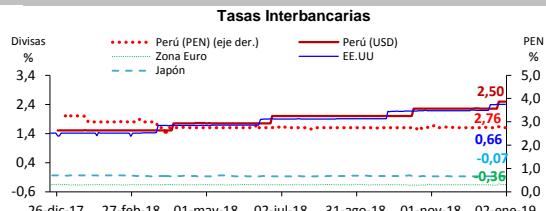
LIQUIDEZ

El BCRP subastó **Repo Valores Overnight** por S/ 1 150 millones a una tasa de interés promedio de 3,03% (1:35 pm), colocó **Repo Valores 1 semana** por S/ 300 millones a una tasa de interés promedio de 3,38% (1:20 pm), colocó **Repo Monedas a 6 meses** por S/ 300 millones a una tasa de interés promedio de 3,93% (1:05 pm), subastó **CD BCRP a 18 meses** por S/ 50 millones a una tasa de interés promedio de 3,11% (11:05 am), subastó **Repo Valores Overnight** por S/ 500 millones a una tasa de interés promedio de 3,33% (10:35 am).

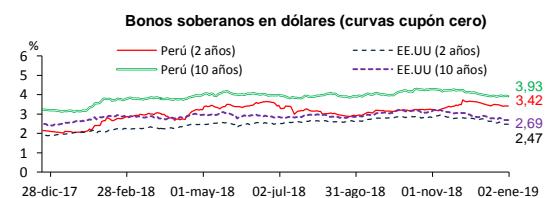
La tasa de interés interbancaria promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,50%.

Tasa de inflación anual Lima Metropolitana: diciembre 2,19%.

La probabilidad de incremento de la tasa de la Reserva Federal según Bloomberg para la reunión del 30/01/2019 es 0,0%.



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



Fuente: BCRP, Bloomberg



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

CURVAS DE RENDIMIENTO

En EEUU:

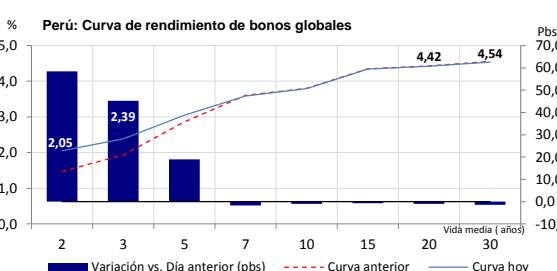
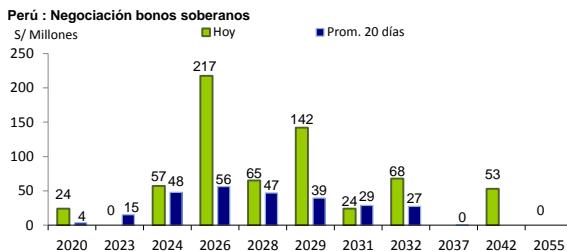
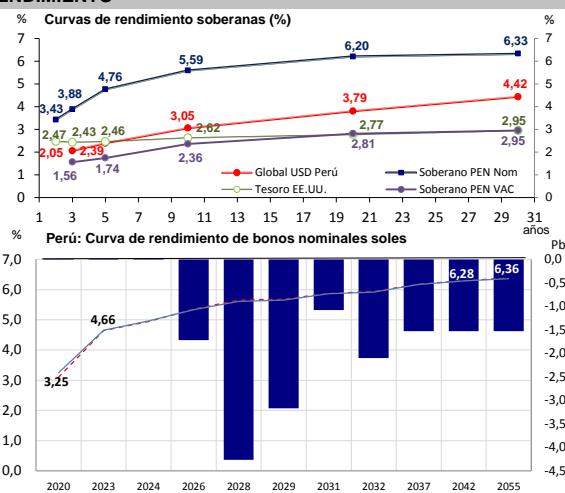
La curva de rendimiento del Tesoro disminuyó 3,9 pb en promedio con respecto a la jornada anterior, debido a un mayor apetito al riesgo por renta fija.

En Perú:

Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 650,59 millones. Datafec informó por posición de compra S/ 226,59 millones, venta S/ 210,00 millones y operaciones de registro S/ 214,00 millones.

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

La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares se incrementó en 14,6 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

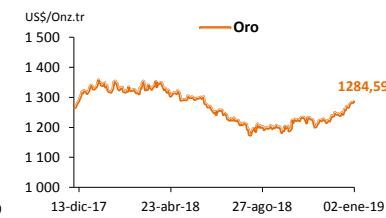
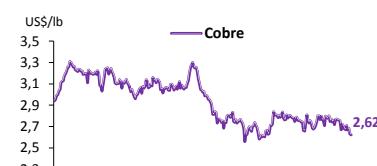
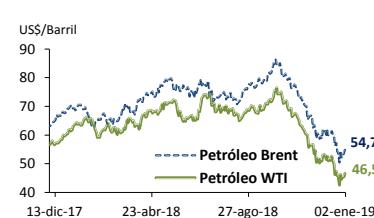


MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	46,54	1,130	2,49%
Brent	54,76	0,960	1,78%
Cobre	2,62	-0,008	-0,30%
Oro	1284,59	1,990	0,16%
Plata	15,52	0,012	0,08%

El precio del crudo WTI subió (2,49%) a US\$ 46,54/bbl después que se reforzaron los signos de suministros más ajustados de Arabia Saudí, los cuales compensaron la producción récord en EEUU y Rusia, y la preocupación por una desaceleración de la economía a nivel global.



Fuente: Bloomberg

Indicadores económicos de hoy

EEUU, el Markit fabricación PMI (dic F) disminuyó levemente a 53,8 (consenso y anterior 53,9). Eurozona, el Markit fabricación PMI (dic F) se mantuvo a 51,4 (consenso y anterior 51,4).

Calendario económico para el día jueves, 03 de enero de 2019 (hora de Lima)

EEUU:

- 08:15 a.m.: ADP cambio de empleo (dic) (consenso 180k y anterior 179k).
- 08:30 a.m.: Peticiones iniciales de desempleo (29 dic) (consenso 220k anterior 216k).
- 08:30 a.m.: Reclamos continuos (22 dic) (consenso 1689k anterior 1701k).
- 10:00 a.m.: ISM manufacturero (dic) (consenso 57,5 anterior 59,3).

Eurozona:

- 04:00 p.m.: Oferta de dinero M3 YoY (nov) (consenso 3,8% anterior 3,9%).

China:

- 08:45 pm: Composite PMI de China Caixin (dic) (anterior 51,9).
- 08:45 pm: Servicios PMI de China Caixin (dic) (consenso 53,0 anterior 53,8).

Japón:

- 07:30 p.m.: PMI Nikkei fabricación (dic F) (anterior 52,4).