



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3679 soles 0,000 -0,01%

3 de enero de 2019

Dow Jones: 22686,22 -660,02 -2,83%

Última actualización 03/01/2019 18:14

CONTEXTO DE HOY*

En la sesión de hoy, los principales mercados bursátiles de EEUU cerraron a la baja (DJI: -283 pbs), luego de la revisión a la baja en la expectativa de ingresos del gigante tecnológico Apple, así como un dato manufacturero en Estados Unidos por debajo de lo esperado por los analistas en diciembre. En ese contexto, la curva del Tesoro de EEUU se redujo en 6,1 puntos básicos (pb) en promedio en la sesión. El rendimiento del USTN 10 años se redujo a 2,554% (anterior 2,621%) y el USTN 2 años disminuyó a 2,380% (anterior 2,470%). El dólar se depreció a nivel global frente a la apreciación del euro, la libra esterlina y el yen.

A nivel local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles se incrementó en 1,2 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/ 670,98 millones según Data tec, de los cuales se compraron S/ 47,50 millones, vendieron S/ 157,48 millones y se transaron S/ 466,00 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2028 (S/ 466,0 millones) y 2020 (S/ 63,0 millones).

Por otro lado, el sol se apreció 0,01% en una jornada donde se renovaron los temores por parte de los inversionistas por una desaceleración de China. Según Reuters, se negoció US\$ 552 millones en el mercado local en la sesión.

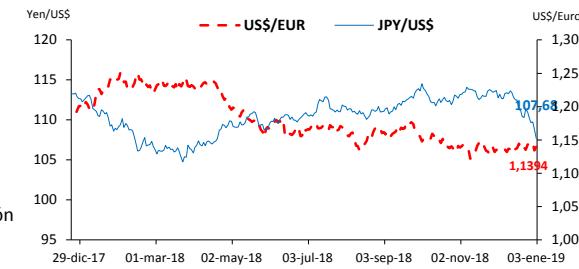
* La información del contexto no expresa la opinión del Ministerio de Economía y Finanzas.

DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Monedas	Cierre	Var. %	Estado
Dólar (BBDXY)	1194,02	-0,48	deprecia
Dólar (DXY)	96,28	-0,56	deprecia
Euro	1,1394	0,44	aprecia
Libra esterlina	1,2628	0,17	aprecia
Yen	107,68	-1,10	aprecia
Yuan	6,872	0,15	deprecia
Sol	3,3679	-0,01	aprecia

El dólar BBDXY se depreció a nivel global en medio de una apreciación del euro, la libra esterlina y el yen.

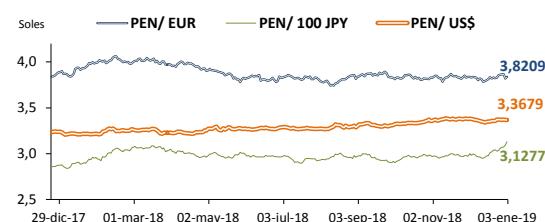


Fuente: Bloomberg

El sol se apreció levemente en 0,01% (S/3,368 por dólar) luego de que una oferta de dólares de administradoras de fondos de pensión y empresas contrarrestó una demanda inicial de inversores extranjeros ante una caída de los mercados.

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

Desde inicios del año 2019, la moneda nacional se ha apreciado 0,12%.



Fuente: Bloomberg

LÍQUIDEZ

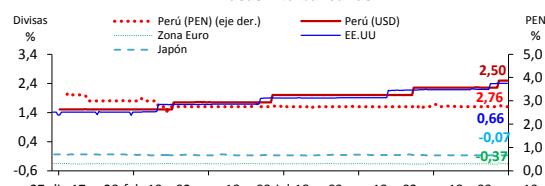
El BCRP subastó CD BCRP a 12 meses por S/ 50 millones a una tasa de interés promedio de 2,90% (11:05 am).

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

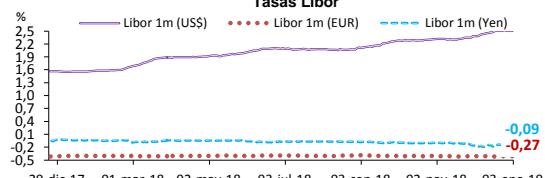
Tasa de inflación anual Lima Metropolitana: diciembre 2,19%.

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

Tasas Interbancarias



Tasas Libor

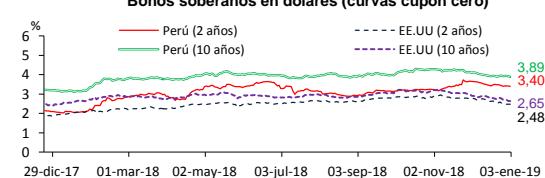


Perú : Banco Central de Reserva



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

Bonos soberanos en dólares (curvas cupón cero)



Fuente: BCRP, Bloomberg



PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

CURVAS DE RENDIMIENTO

En EEUU:

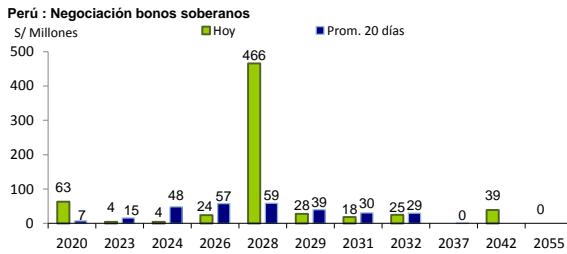
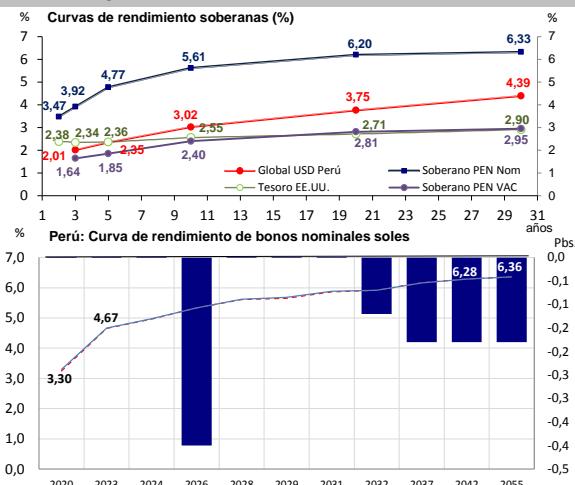
La curva de rendimiento del Tesoro disminuyó 6,1 pb en promedio con respecto a la jornada anterior, debido a un mayor apetito al riesgo por renta fija.

En Perú:

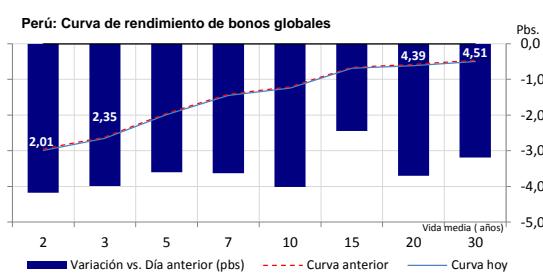
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 670,98 millones. Data tec informó por posición de compra S/ 47,50 millones, venta S/ 157,48 millones y operaciones de registro S/ 466,00 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles se incrementó en 1,2 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares disminuyó en 3,6 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

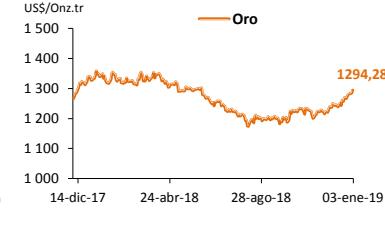
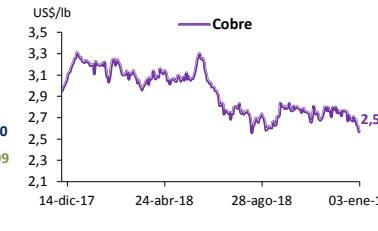
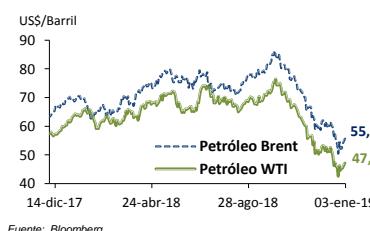


MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	47,09	0,550	1,18%
Brent	55,60	0,690	1,26%
Cobre	2,57	-0,055	-2,10%
Oro	1294,28	9,690	0,75%
Plata	15,74	0,220	1,42%

El precio del crudo WTI subió (1,18%) a US\$ 47,09/bbl alentado, según los analistas, por el bajo valor del dólar y las intenciones mostradas de Arabia Saudí de reducir sus suministros de petróleo.



Fuente: Bloomberg

Indicadores económicos de hoy

EEUU, el ADP cambio de empleo (dic) disminuyó a 271k (consenso 180k anterior 179k), las peticiones iniciales de desempleo (29 dic) se elevaron a 231k (consenso 220k anterior 216k), los reclamos continuos (22 dic) se incrementaron a 1740k (consenso 1690k anterior 1701k), el ISM manufacturero (dic) disminuyó a 54,1 (consenso 57,5 anterior 59,3), las solicitudes de hipoteca MBA (28 dic) se redujeron más de lo esperado a -8,5% (consenso -1,4%). **Eurozona**, la oferta de dinero M3 YoY (nov) disminuyó a 3,7% (consenso 3,8% anterior 3,9%).

Calendario económico para el día viernes, 04 de enero de 2019 (hora de Lima)

EEUU:

08:30 a.m.: Cambio en nóminas no agrícolas (dic) (consenso 184k anterior 155k).
 08:30 a.m.: Tasa de desempleo (dic) (consenso 3,7% anterior 3,7%).

Eurozona:

05:00 p.m.: IPC subyacente YoY (dic A) (consenso 1,0% anterior 1,0%).
 05:00 p.m.: Estimación de IPC YoY (dic) (consenso 1,7% anterior 2,0%).