

PRINCIPALES INDICADORES FINANCIEROS Y ECONÓMICOS

Dólar US: 3,3453 soles -0,023 -0,67%

4 de enero de 2019

Dow Jones: 23433,16 746,94 3,29%
Última actualización 04/01/2019 18:08

CONTEXTO DE HOY*

En la sesión de hoy, los principales mercados bursátiles de EEUU cerraron al alza impulsados por diversos eventos: el presidente de la Fed indicó en una ponencia que podría pausar los aumentos en la tasa de referencia de ser necesario, los datos de las nóminas no agrícolas superaron ampliamente los estimados en diciembre (312k nuevos empleos), y China anunció nuevas negociaciones comerciales con EEUU la siguiente semana. En ese contexto, la curva del Tesoro de EEUU se incrementó en 10,1 puntos básicos (pb) en promedio en la sesión. El rendimiento del USTN 10 años subió a 2,669% (anterior 2,554%) y el USTN 2 años disminuyó a 2,495% (anterior 2,380%). El dólar se depreció a nivel global a raíz de anuncios sobre una reducción de requisitos de reservas bancarias en China y nuevas negociaciones comerciales con Estados Unidos.

A nivel local, la curva de rendimiento de bonos soberanos en soles disminuyó en 0,2 pb en promedio, debido a una mayor demanda de papeles por parte de clientes corporativos. La negociación de bonos soberanos en soles en la jornada ascendió a S/ 587,63 millones según Datatec, de los cuales se compraron S/ 200,50 millones, vendieron S/ 239,13 millones y se transaron S/ 148,00 millones en operaciones de registro. Los bonos más negociados en la sesión fueron los bonos 2026 (S/ 263,9 millones) y 2029 (S/ 111,0 millones).

Por otro lado, el sol se apreció -0,67% en una jornada donde primaron las ventas de dólares de inversores extranjeros ante una menor aversión global al riesgo. Según Reuters, se negoció US\$ 629 millones en el mercado local en la sesión.

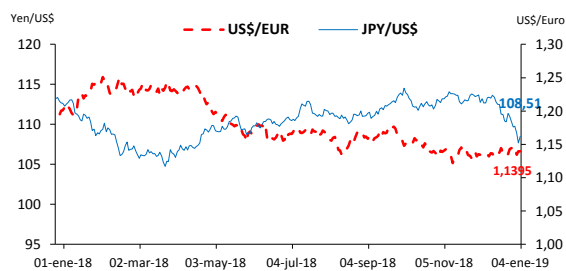
* La información del contexto no expresa la opinión del Ministerio de Economía y Finanzas.

DIVISAS

Respecto a la jornada anterior:

Moneda	Cierre	Var. %	Estado
Dólar (BBDXY)	1191,38	-0,22	deprecia
Dólar (DXY)	96,20	-0,11	deprecia
Euro	1,1395	0,01	aprecia
Libra esterlina	1,2723	0,75	aprecia
Yen	108,51	0,77	deprecia
Yuan	6,869	-0,04	aprecia
Sol	3,3453	-0,67	aprecia

El **dólar BBDXY** se depreció a nivel global en medio de una apreciación del euro, la libra esterlina, el yuan y otras monedas de mercados emergentes.

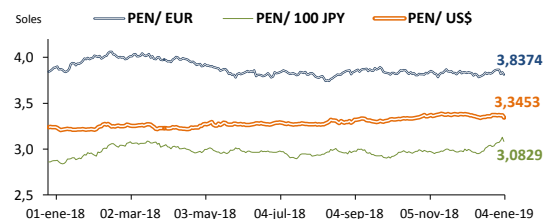


Fuente: Bloomberg

El **sol** se apreció en -0,67% (S/3,345 por dólar), siendo su mayor alza porcentual diaria en casi ocho meses por ventas de dólares de inversores extranjeros ante una menor aversión global al riesgo por expectativas de una nueva negociación comercial entre EEUU y China.

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

Desde inicios del año 2019, la moneda nacional se ha apreciado **0,79%**.



Fuente: Bloomberg

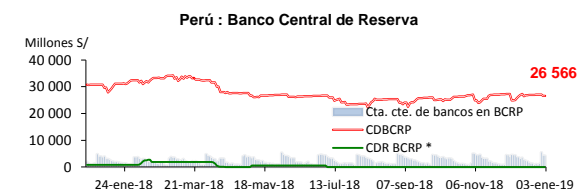
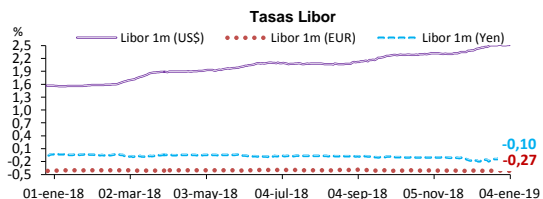
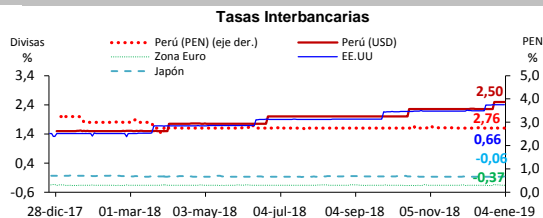
LIQUIDEZ

El **BCRP** no subastó **CD BCRP**, ni otros instrumentos financieros.

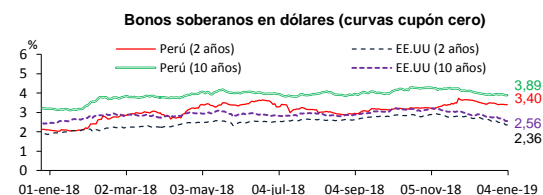
La **tasa de interés interbancaria** promedio en soles fue de 2,75% y dólares 2,50%.

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:

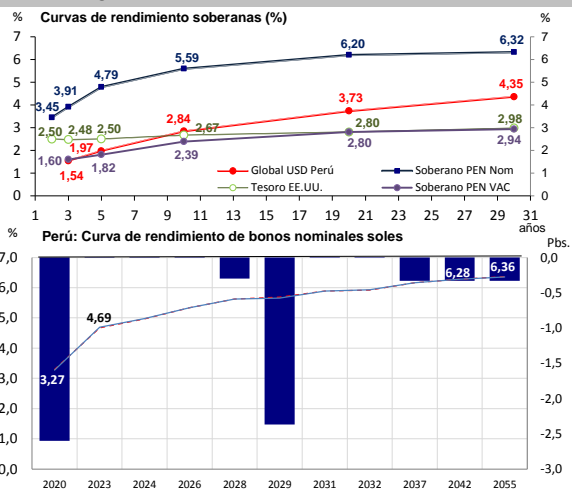
La curva de rendimiento del Tesoro se incrementó 10,1 pb en promedio con respecto a la jornada anterior, debido a un mayor apetito al riesgo por renta variable.

En Perú:

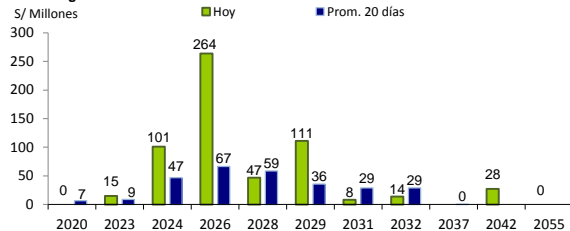
Se registraron transacciones de bonos soberanos nominales por S/ 587,63 millones. Datatec informó por posición de compra S/ 200,50 millones, venta S/ 239,13 millones y operaciones de registro S/ 148,00 millones.

La curva de rendimiento soberana en soles se redujo en 0,2 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.

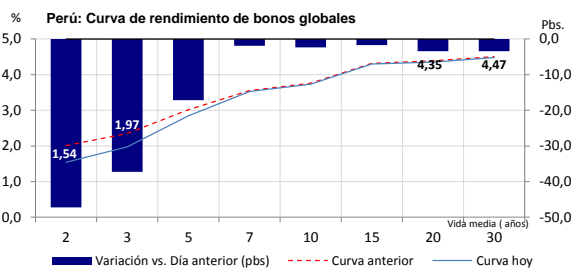
La curva de rendimiento de los bonos soberanos en dólares disminuyó en 14,3 pb en promedio con respecto a la jornada anterior.



Perú : Negociación bonos soberanos



Fuente: Bloomberg y Ministerio de Economía y Finanzas

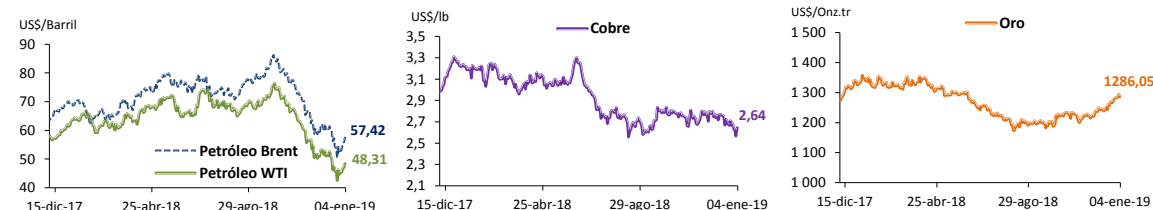


MATERIAS PRIMAS

Respecto a la jornada anterior:

Bien	Precio	Var.	Var. %
WTI	48,31	1,220	2,59%
Brent	57,42	1,470	2,63%
Cobre	2,64	0,075	2,92%
Oro	1286,05	-8,230	-0,64%
Plata	15,70	-0,043	-0,27%

El precio del crudo WTI subió (2,59%) a US\$ 48,31/bbl alentado por unas previsiones de recortes de la producción, un dólar competitivo y unos mercados que, aunque volátiles, acabaron con ganancias.



Fuente: Bloomberg

Indicadores económicos de hoy

EEUU, el cambio en nóminas no agrícolas (dic) se incrementó a 312k mostrando solidez (consenso 184k anterior 155k), la tasa de desempleo (dic) se elevó a 3,9% (consenso y anterior 3,7%). Eurozona, el IPC subyacente YoY (dic A) se mantuvo a 1,0% (consenso y anterior 1,0%), la estimación de IPC YoY (dic) se redujo a 1,6% (consenso 1,7% anterior 2,0%).

Calendario económico para el día lunes, 07 de enero de 2019 (hora de Lima)

EEUU:

10:00 a.m.: Índice ISM no de fabricación (dic) (consenso 59,0 anterior 60,7).