Informe diario de mercados e instituciones financieras internacionales

Información al 13 de diciembre de 2013

Departamento de Análisis Económico y
Estándares de Supervisión
Área de Análisis Económico y Financiero

SUPERINTENDENCIA DE BANCOS

Trabajamos para promover la estabilidad y confianza en el sistema financiero supervisado

Precios materias primas y principales índices bursátiles

Comportamiento de las Principales Materias Primas

		Valor de Cierre				Variación Porcentual (%) respecto al:	
Unidad de Medida	Índice	14-dic-12	13-dic-12	12-dic-13	13-dic-13	Año anterior	Día anterior
US$/Barril	Petróleo WTI, Spot	86.73	85.89	97.50	96.44	↑ 12.28	↓ -1.09
US$/Barril	Petróleo Brent, Spot	109.15	107.91	108.67	108.73	↑ 0.76	↑ 0.06
US$/Quintal	Café Contrato "C" (1a. Posición Futuro)	137.40	135.25	110.70	114.50	↓ -15.34	↑ 3.43
US$/Quintal	Azúcar No. 11 (1a. Posición Futuro)	19.01	18.54	16.30	16.27	↓ -12.24	↓ -0.18
US$/Onza	Oro, Spot	1,696.10	1,696.95	1,225.52	1,238.18	↓ -27.03	↑ 1.03
US$ /€	Dólar por Euro	1.31630	1.30770	1.37530	1.37380	↑ 5.05	↓ -0.11
GTQ/US$	Quetzal por Dólar	7.89232	7.87453	7.87151	7.87290	↓ -0.02	↑ 0.02
% Libor	Libor 90 días US$	0.30800	0.30800	0.24285	0.24385	↓ -20.83	↑ 0.41

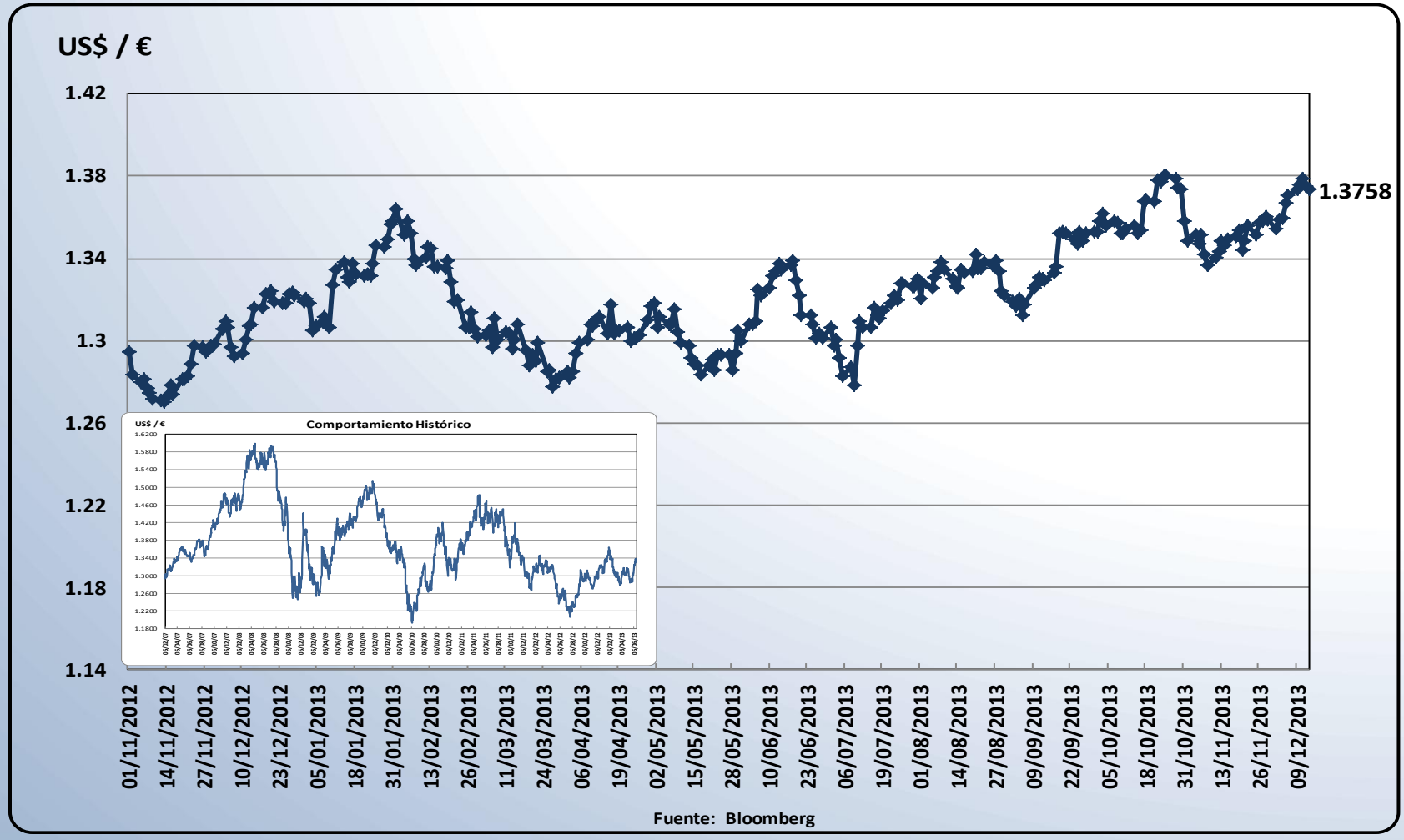
Fuente: Bloomberg y Banguat

Comportamiento de los Principales Índices Bursátiles

		Valor de Cierre				Variación Porcentual (%) respecto al:	
País	Índice	14-dic-12	13-dic-12	12-dic-13	13-dic-13	Año anterior	Día anterior
EEUU	Dow Jones Industrial Average	13,135.01	13,170.72	15,739.43	15,755.36	↑ 19.62	↑ 0.10
EEUU	Nasdaq Composite	2,971.34	2,992.16	3,998.40	4,000.98	↑ 33.72	↑ 0.06
EEUU	S&P 500	1,413.58	1,419.45	1,775.50	1,775.32	↑ 25.07	↓ -0.01
Japón	Nikkei 225	9,737.56	9,742.73	15,341.82	15,403.11	↑ 58.10	↑ 0.40
Hong Kong	Hang Seng	22,605.98	22,445.58	23,218.12	23,245.96	↑ 3.57	↑ 0.12
Inglaterra	FTSE 100	5,921.76	5,929.61	6,445.25	6,439.96	↑ 8.61	↓ -0.08
Alemania	DAX	7,596.47	7,581.98	9,017.00	9,006.46	↑ 18.79	↓ -0.12
Francia	CAC 40	3,643.28	3,643.13	4,069.12	4,059.71	↑ 11.43	↓ -0.23
España	IBEX	8,024.10	8,017.10	9,272.10	9,272.70	↑ 15.66	↑ 0.01
Brasil	Bovespa	59,604.92	59,316.75	50,121.61	50,051.18	↓ -15.62	↓ -0.14
Argentina	MerVal	2,696.98	2,610.03	5,223.31	5,258.27	↑ 101.46	↑ 0.67

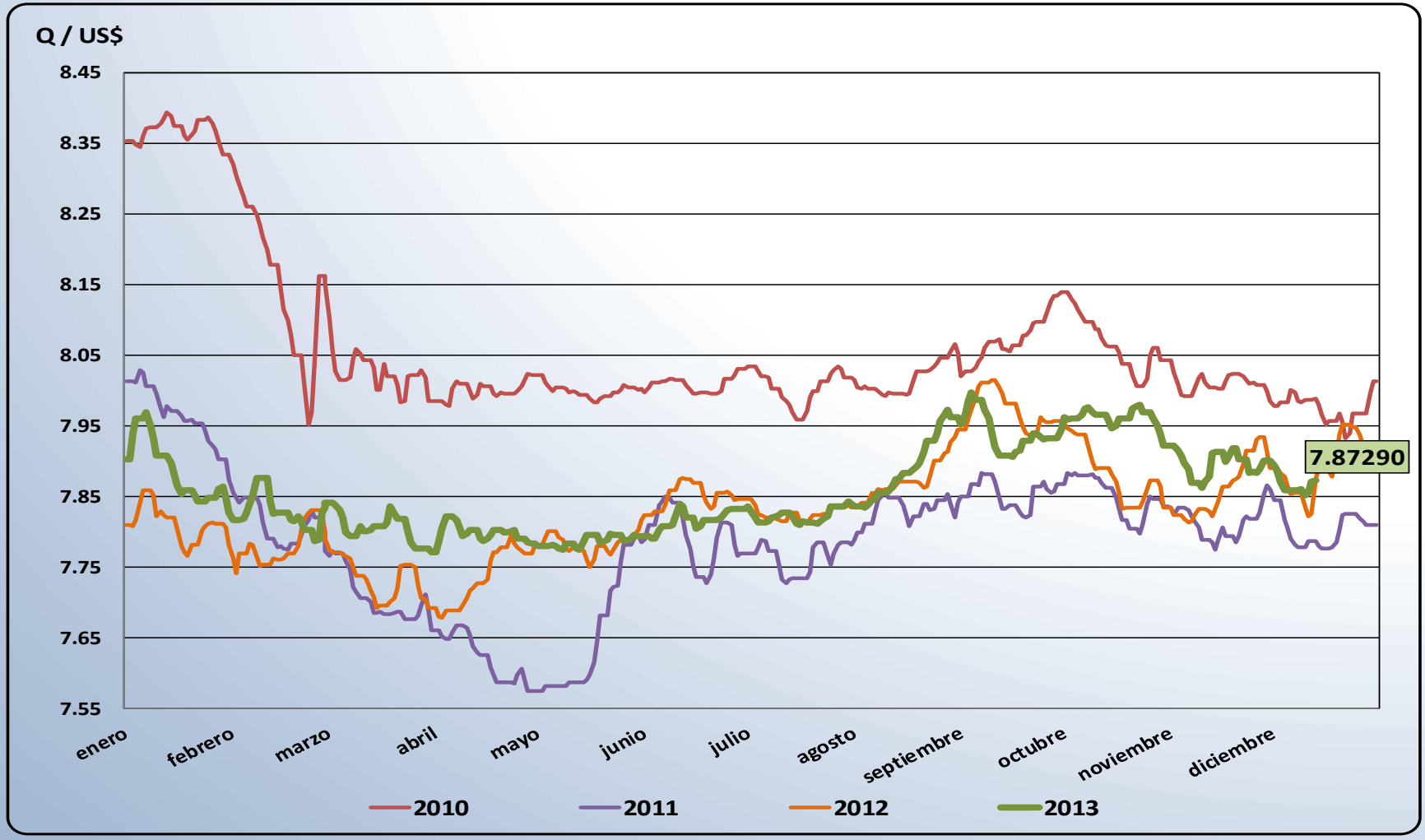
Fuente: Bloomberg

Evolución del Euro en relación al Dólar Estadounidense

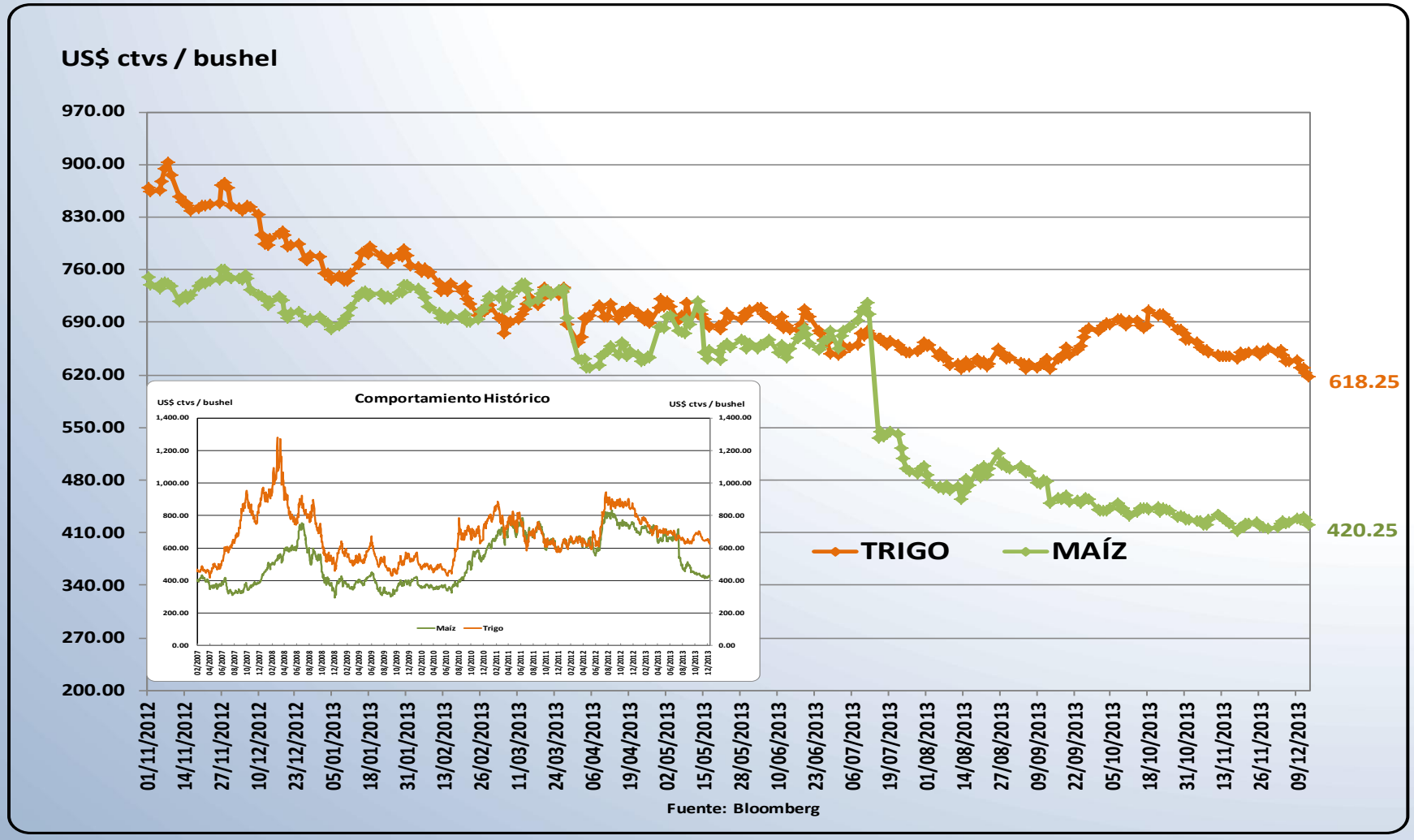


Fuente: Bloomberg

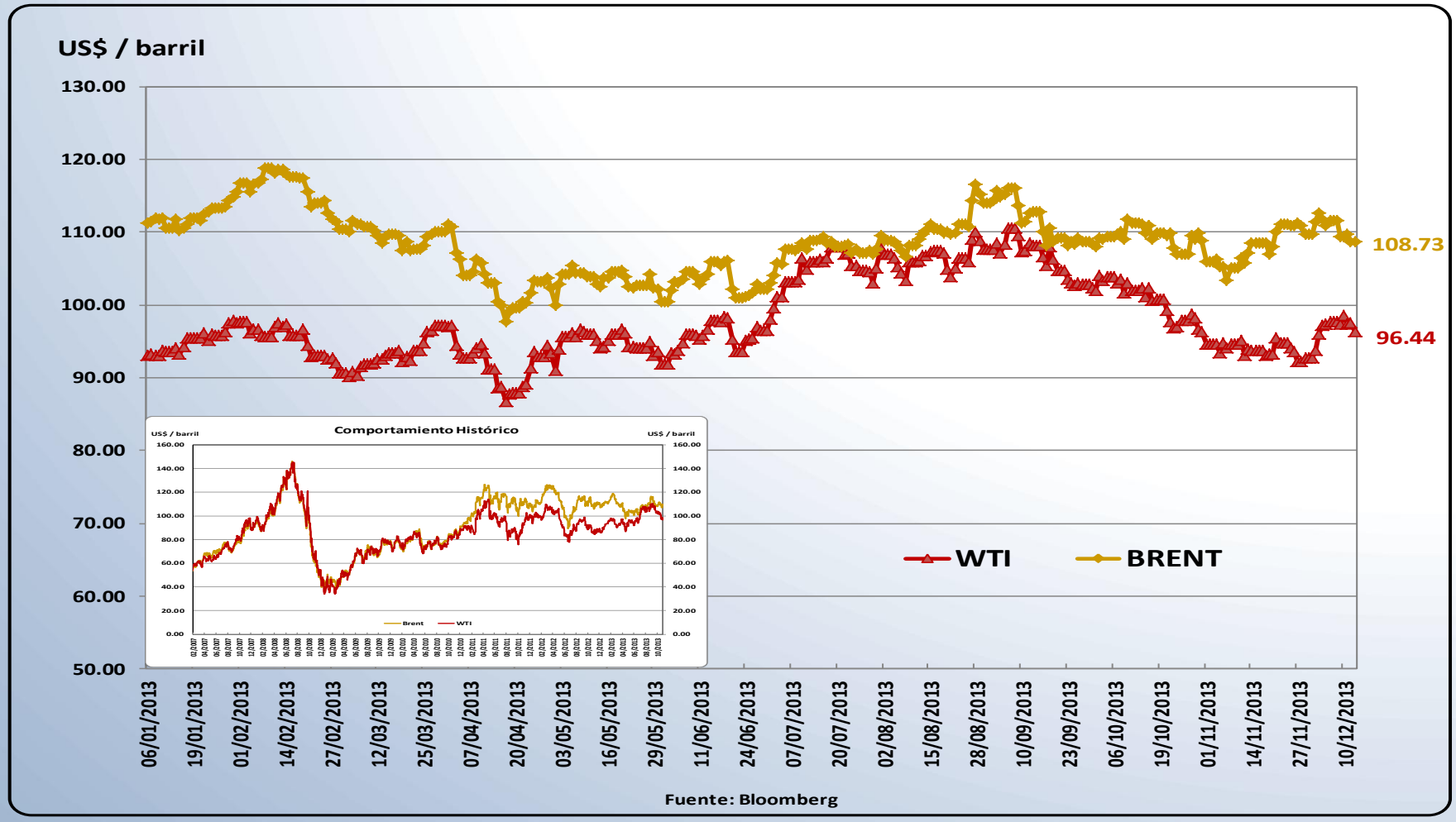
Evolución del Tipo de Cambio diario de Guatemala



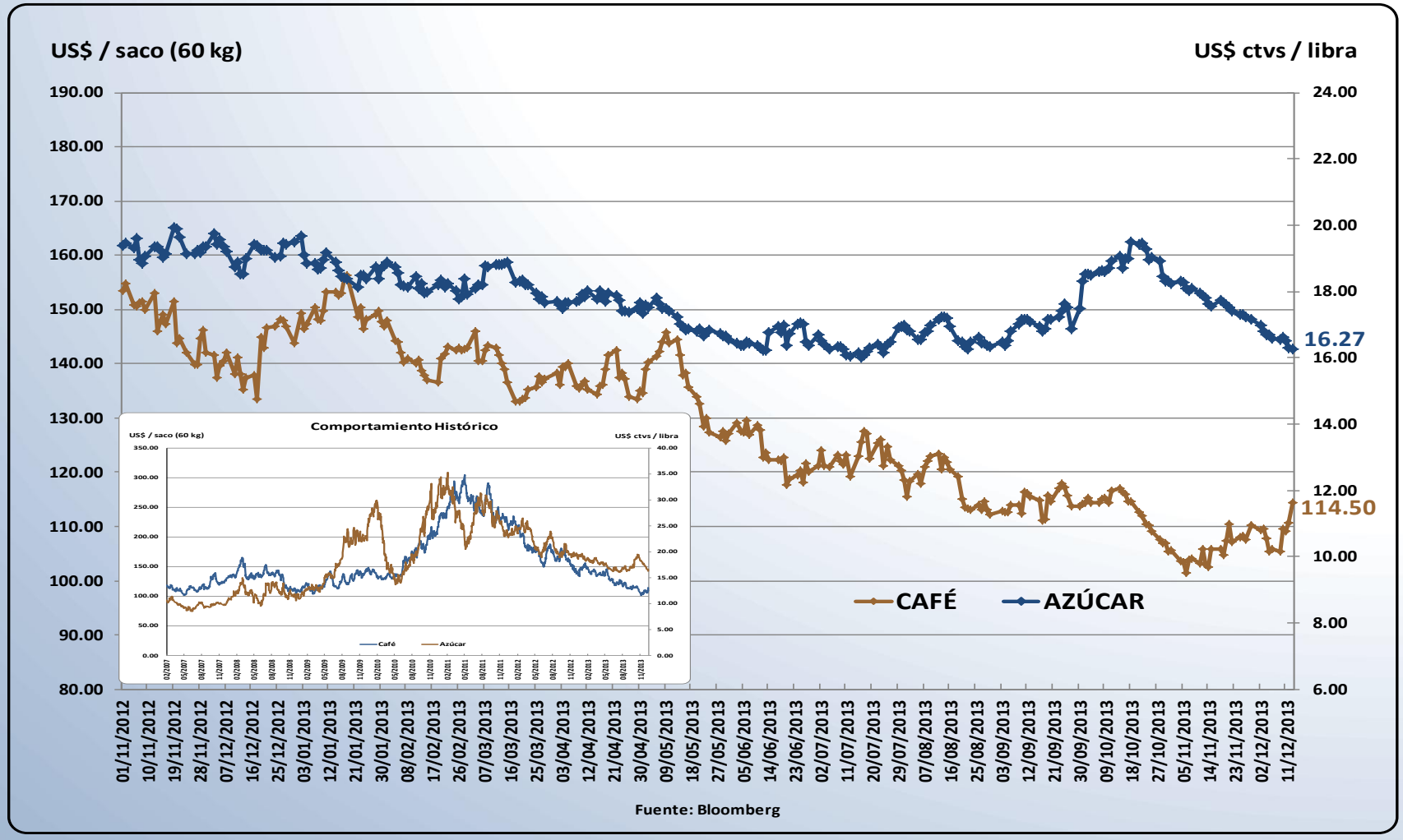
Evolución del precio del trigo y maíz
-1ª posición a futuro-



Evolución del precio del petróleo
-1ª posición a futuro-



Evolución del precio del café y azúcar
-1ª posición a futuro-



Evolución del precio internacional spot de oro

Instituciones financieras internacionales

Principales Bancos Estadounidenses

	Precio Cierre (US$)				Variación Porcentual (%) respecto al:	
Institución	14-dic-12	13-dic-12	12-dic-13	13-dic-13	Año anterior	Día anterior
Citigroup Inc	37.60	37.29	50.91	50.97	36.69	0.12
JPMorgan Chase & Co	42.81	42.78	56.31	56.17	31.30	-0.25
Morgan Stanley	18.05	17.80	30.48	31.09	74.66	2.00
Bank of America Corp	10.58	10.54	15.25	15.18	44.02	-0.46
Wells Fargo & Co	33.15	33.26	43.50	43.73	31.48	0.53
UBS AG	16.35	16.22	18.30	18.25	12.52	-0.27
State Street Corp	45.45	45.35	70.21	69.73	53.76	-0.68
Bank of New York Mellon Corp/T	24.72	24.75	32.84	32.91	32.97	0.21
Northern Trust Corp	47.12	47.55	57.14	57.58	21.09	0.77
Goldman Sachs Group Inc/The	119.36	118.50	168.33	168.39	42.10	0.04

Fuente: Bloomberg

Principales Bancos Europeos

		Precio Cierre (US$)				Variación Porcentual (%) respecto al:	
País	Institución	14-dic-12	13-dic-12	12-dic-13	13-dic-13	Año anterior	Día anterior
Francia	BNP Paribas SA	57.81	56.51	69.11	72.94	29.06	5.53
Francia	Societe Generale SA	38.50	38.09	51.70	54.20	42.29	4.84
Francia	Credit Agricole SA	7.84	7.84	11.58	12.06	53.67	4.12
Alemania	Commerzbank AG	14.05	13.83	14.07	14.69	6.21	4.39
Alemania	Deutsche Bank AG	43.04	43.35	43.25	45.55	5.07	5.31
Inglaterra	Royal Bank of Scotland Group P	4.89	4.84	5.12	5.09	5.23	-0.57
Inglaterra	Barclays PLC	3.82	3.78	4.09	4.05	7.13	-0.98
Bélgica	Dexia SA	0.12	0.12	0.07	0.07	-41.64	5.05
España	Banco Santander SA	7.77	7.72	7.92	8.30	7.55	4.73
España	BBVA	8.95	8.83	10.74	11.30	28.00	5.27

Fuente: Bloomberg

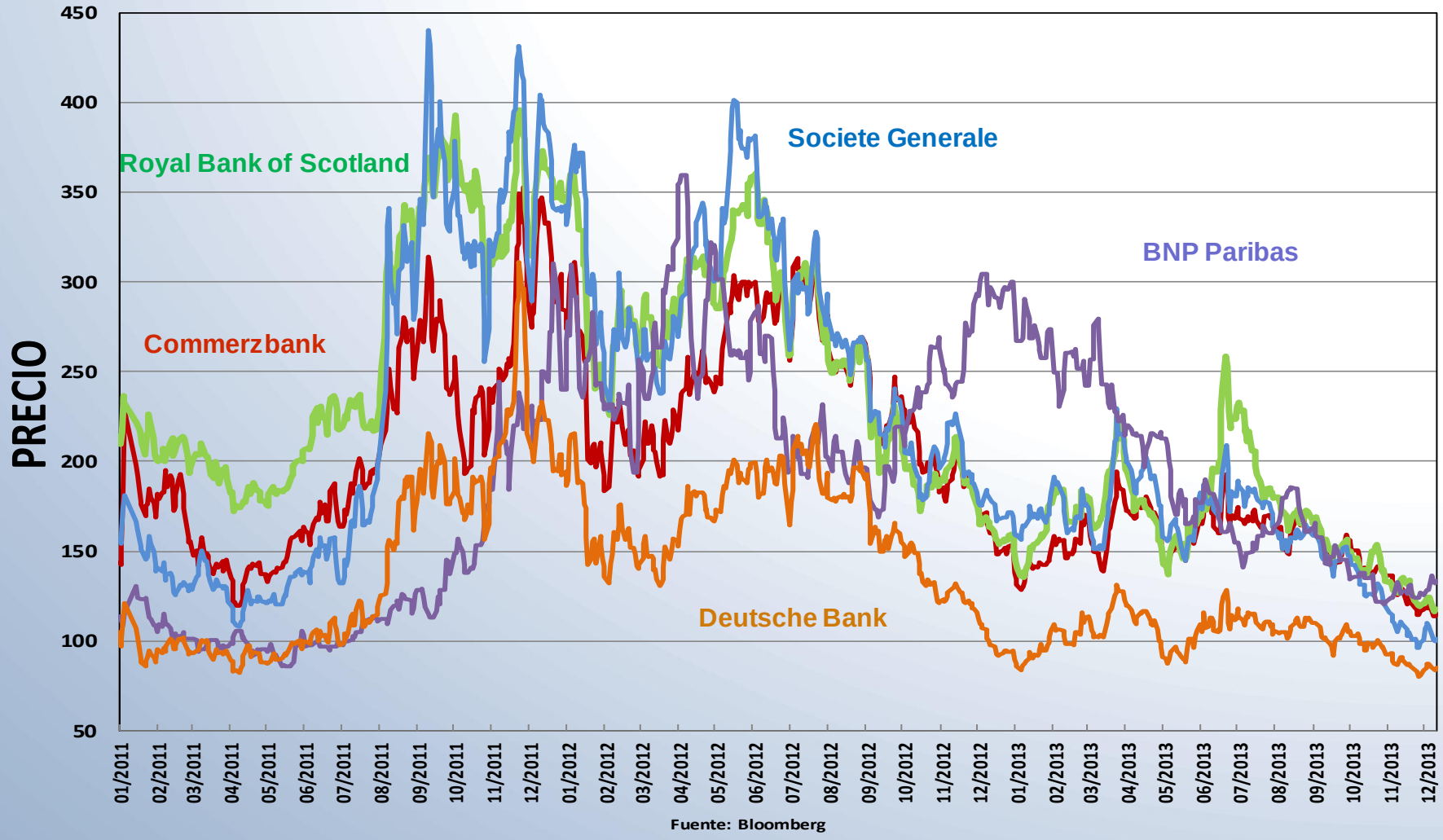
Principales Bancos Latinoamericanos

		Precio Cierre (US$)				Variación Porcentual (%) respecto al:	
País	Institución	14-dic-12	13-dic-12	12-dic-13	13-dic-13	Año anterior	Día anterior
Brasil	Banco do Brasil SA	10.73	10.82	11.42	10.35	-4.34	-9.37
Brasil	Itau Unibanco Holding SA	14.21	14.33	14.84	13.28	-7.32	-10.49
Brasil	Banco Bradesco SA	15.66	15.74	13.62	12.24	-22.19	-10.08
Canadá	Bank of Nova Scotia	57.68	57.70	63.93	59.47	3.06	-6.97
Chile	Banco de Chile	0.15	0.15	0.16	0.14	-8.22	-10.81
Colombia	Bancolombia SA	16.54	16.59	13.12	12.16	-26.66	-7.31
Colombia	Banco de Bogota SA	30.34	30.44	37.29	34.58	13.58	-7.27

Fuente: Bloomberg

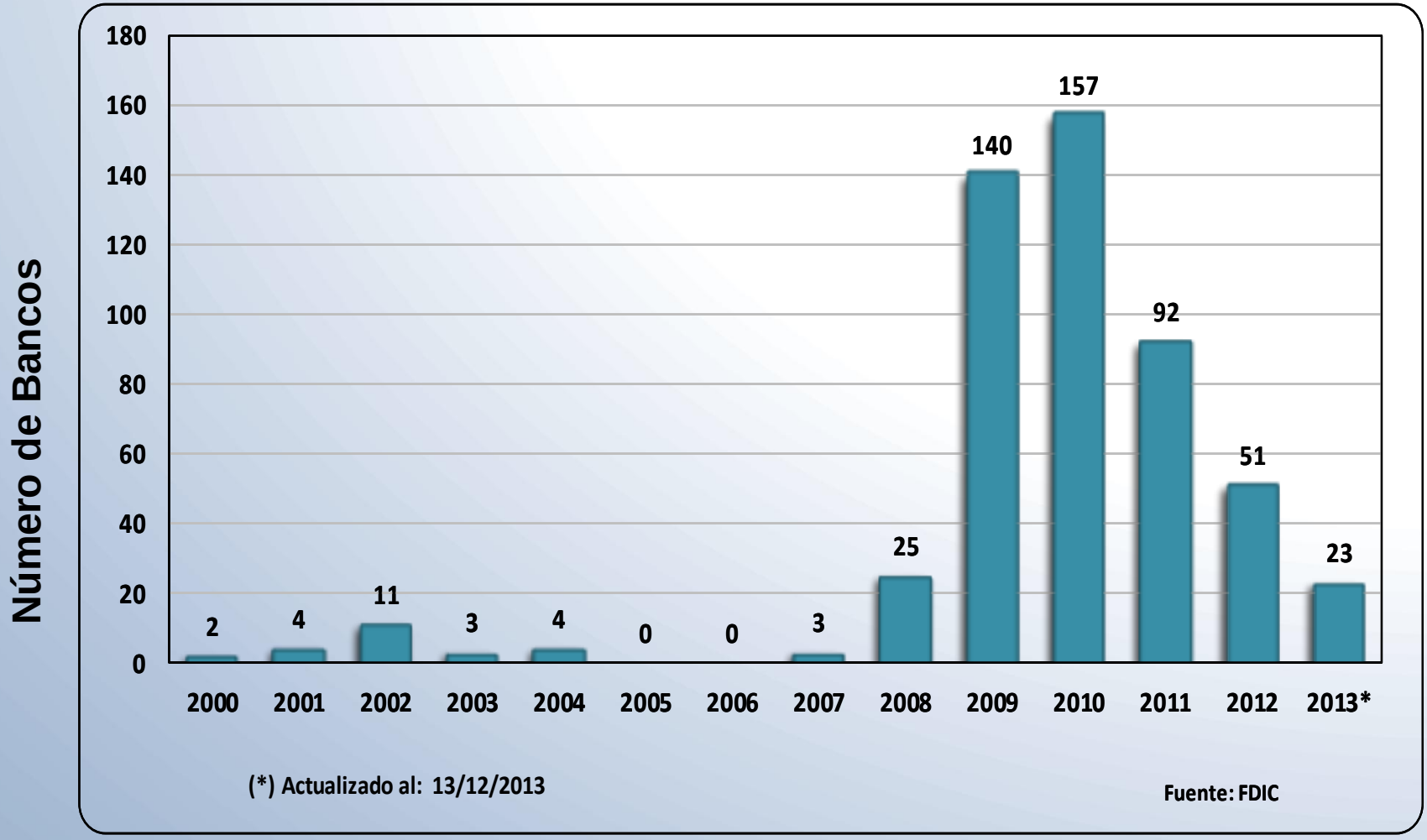
CDS de los Principales Bancos Europeos

En puntos base



Bancos Quebrados en Estados Unidos

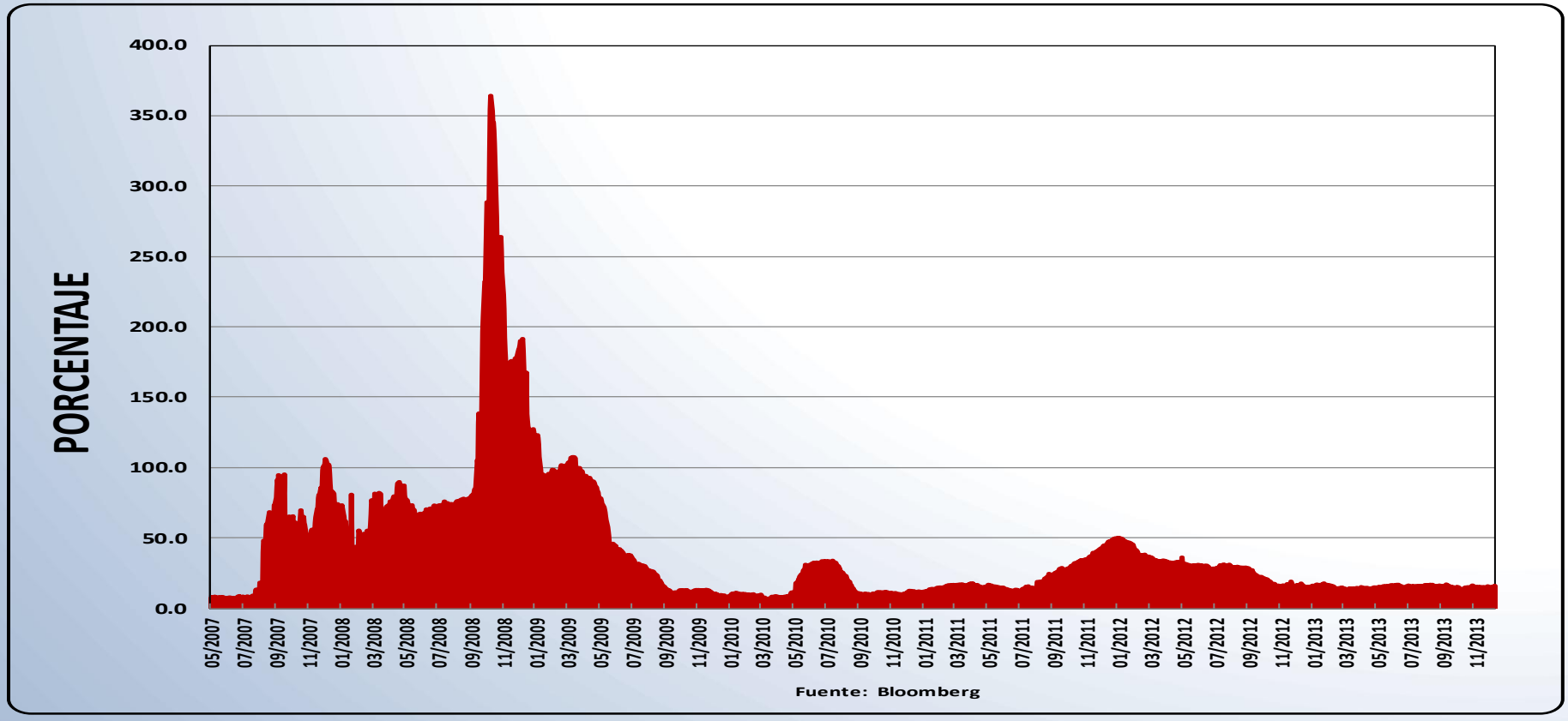
Años 2000-2013



Indicador del Mercado Financiero - Crediticio

USD 3M Libor - OIS

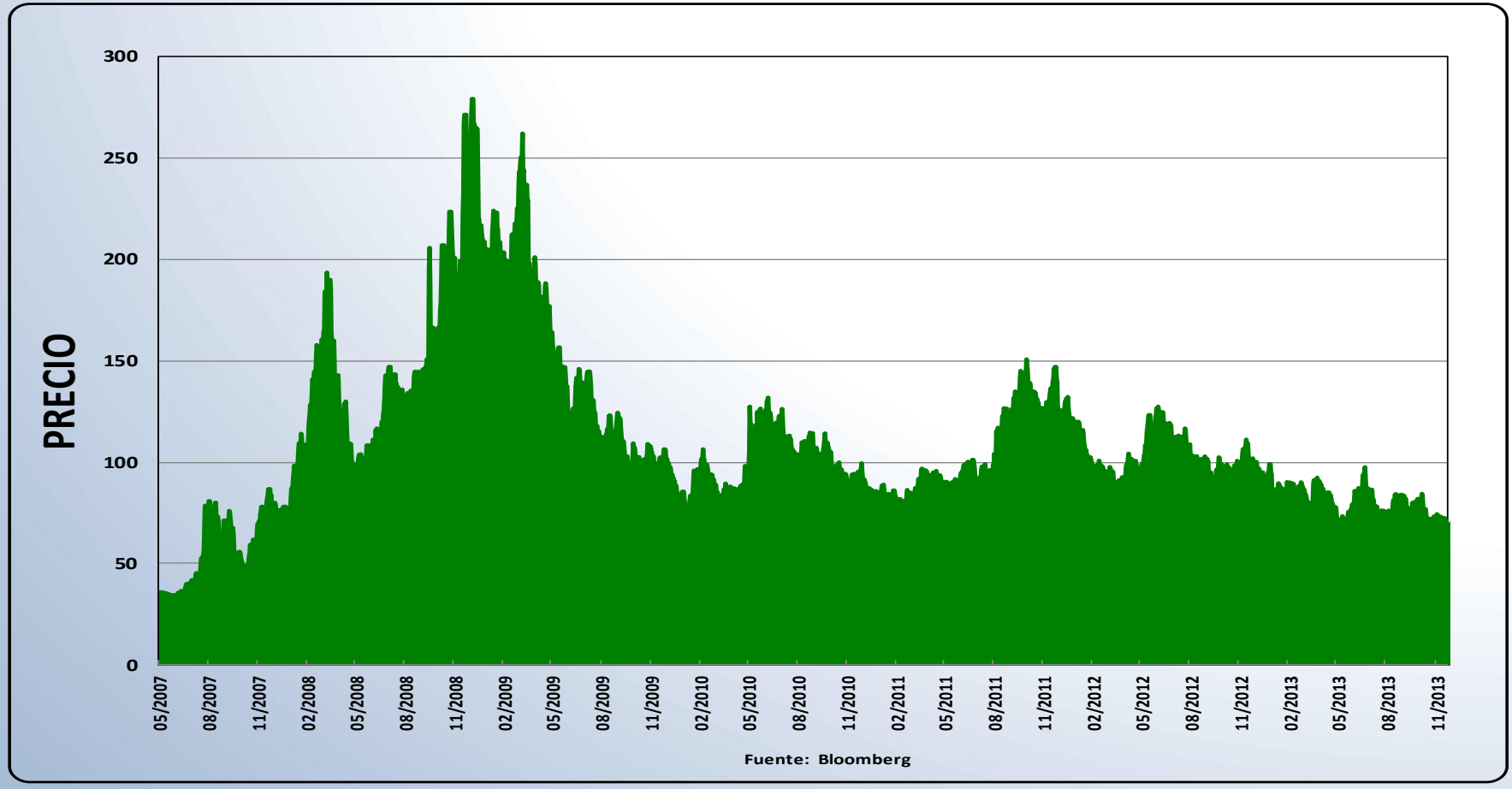
(Medidor del riesgo crediticio en el mercado de préstamos interbancarios)



•Al **subir el spread** (derivado de altas tasas de interés overnight), representa que existe una **mayor restricción de acceso al crédito y desconfianza por impago (default) entre los bancos**. Estos cargan con altas tasas de interés sus operaciones de corto plazo para **compensar la toma de mayor riesgo**. Dado que la tasa del overnight index swap está basada en las tasas fijadas por el banco central, al restarse de la tasa Libor se muestra la tasa de interés aplicada específicamente al riesgo de crédito.

CDX Inv Grade Index 5Y

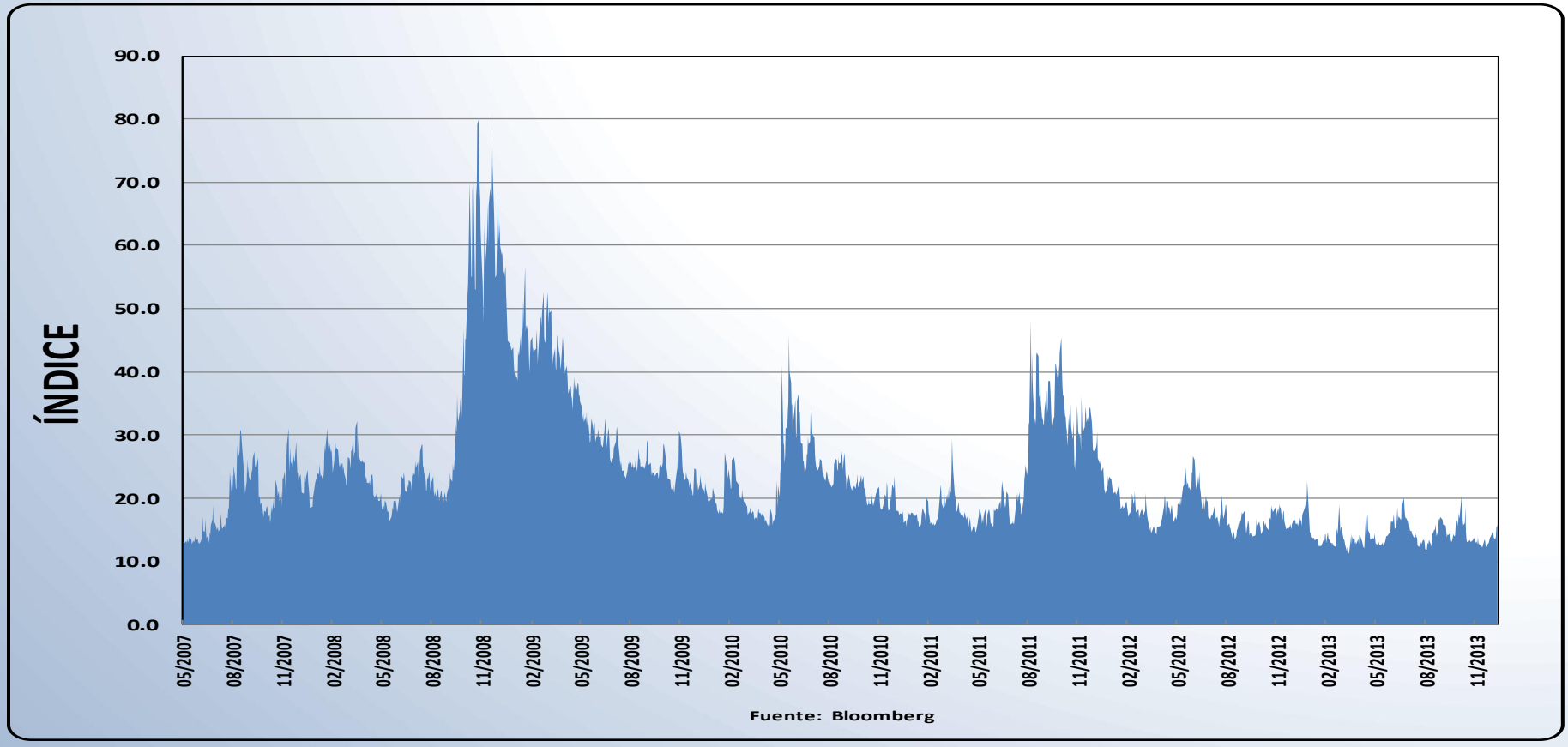
(Exposición a instrumentos crediticios riesgosos)



Este indicador mide el costo de compra de protección tomando en cuenta el riesgo de crédito sobre las 125 compañías de Estados Unidos en grados de inversión.

Chicago Board Options Exchange Volatility Index

(Medidor del miedo del inversionista)



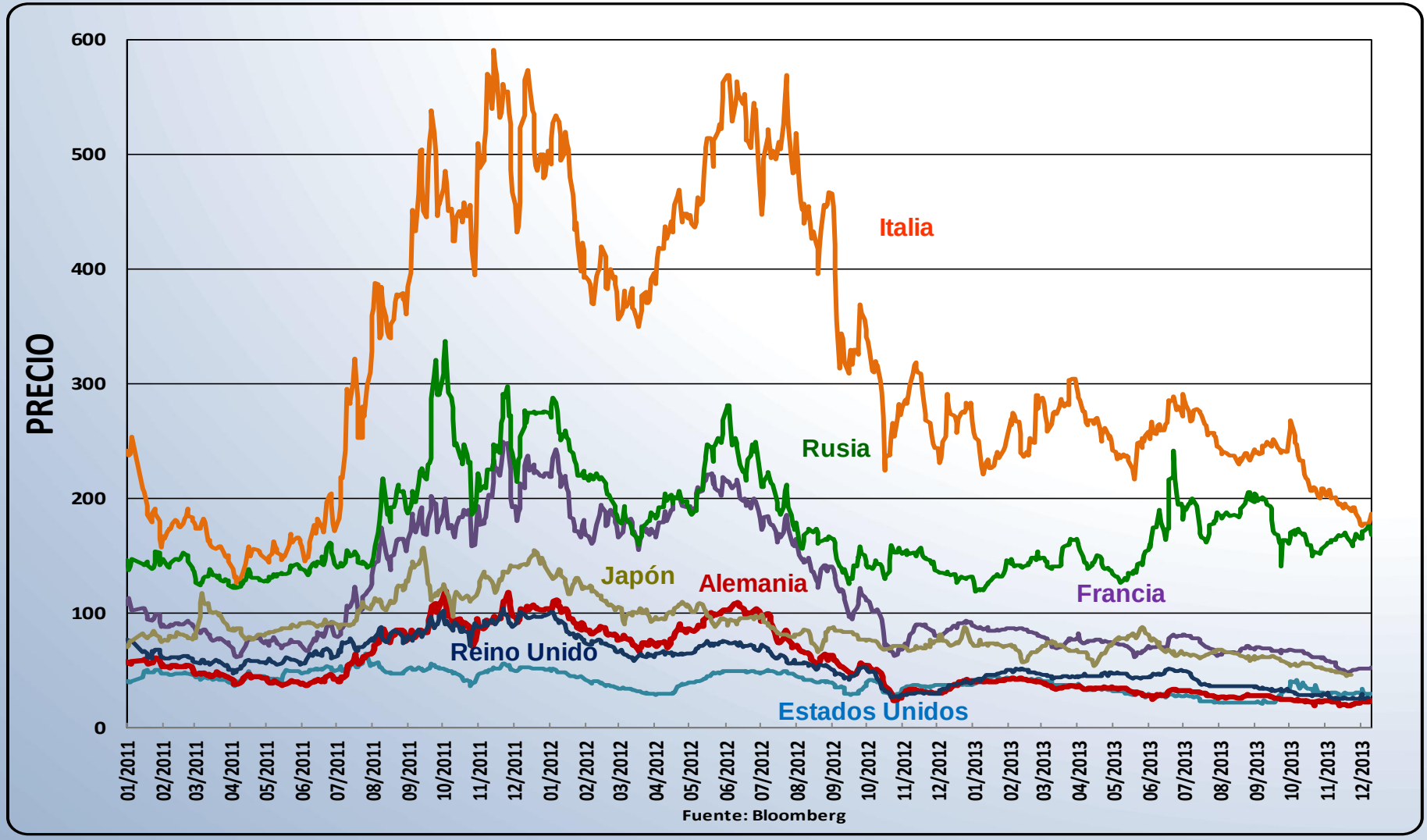
Este indicador conocido comúnmente como **"Indicador del Miedo del Inversionista"** mide la volatilidad futura de los precios de las opciones puts y calls del S&P500. Un índice alto refleja una expectativa de **mercado más volátil en los próximos 30 días** y por ende **opciones** más costosas, lo cual redunda en la mayor utilización de opciones (puts) para cubrir los riesgos derivados de dicha volatilidad. Dicho indicador se encuentra expresado en porcentaje.

Comportamiento de los *Credit Default Swaps* de países considerados del G-7*

***Término típicamente empleado para referirse a los países más ricos del mundo: Estados Unidos, Reino Unido, Japón, Alemania, Italia, Francia y Rusia

Credit Default Swaps (Países G-7)

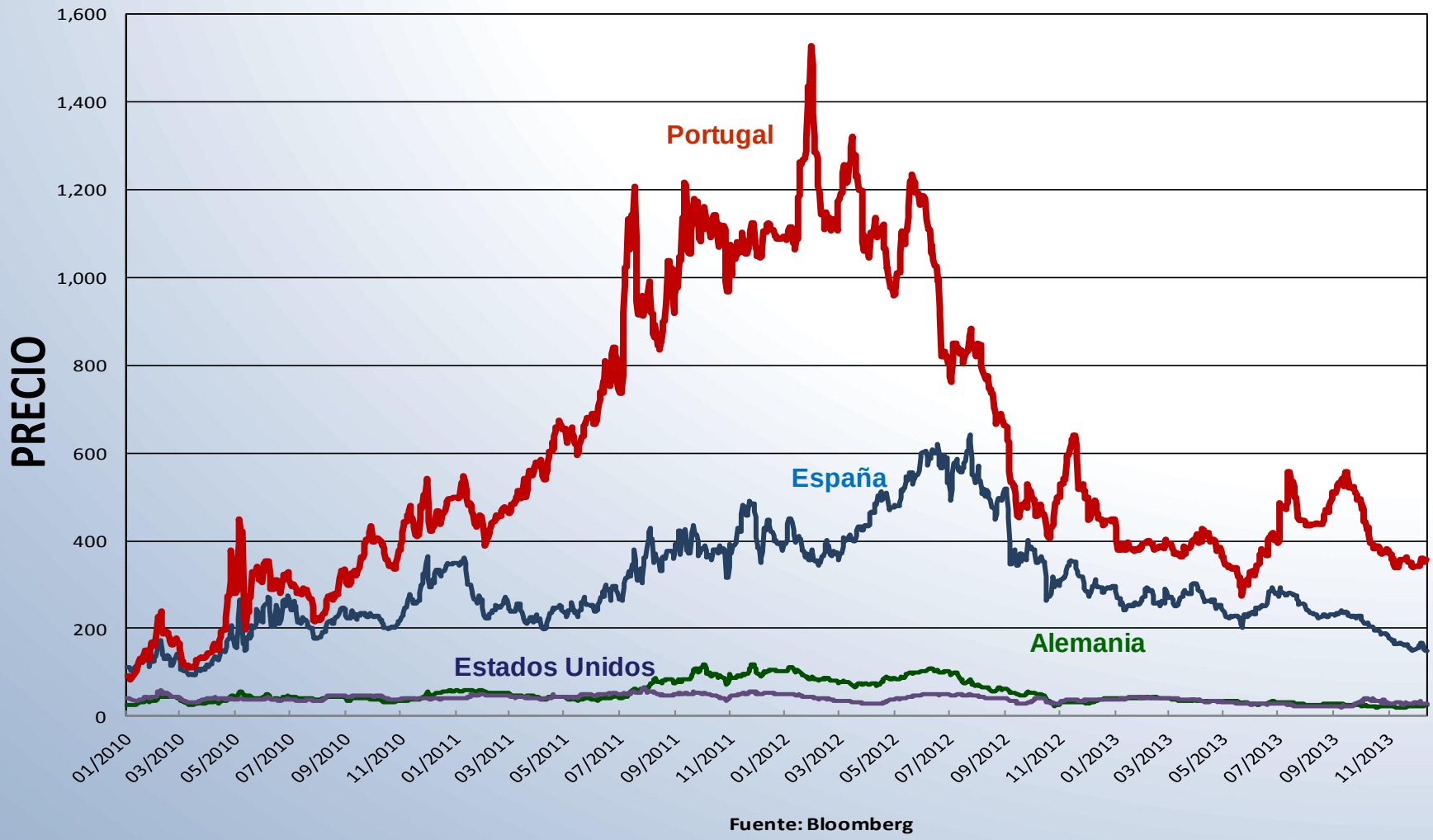
-En puntos base-



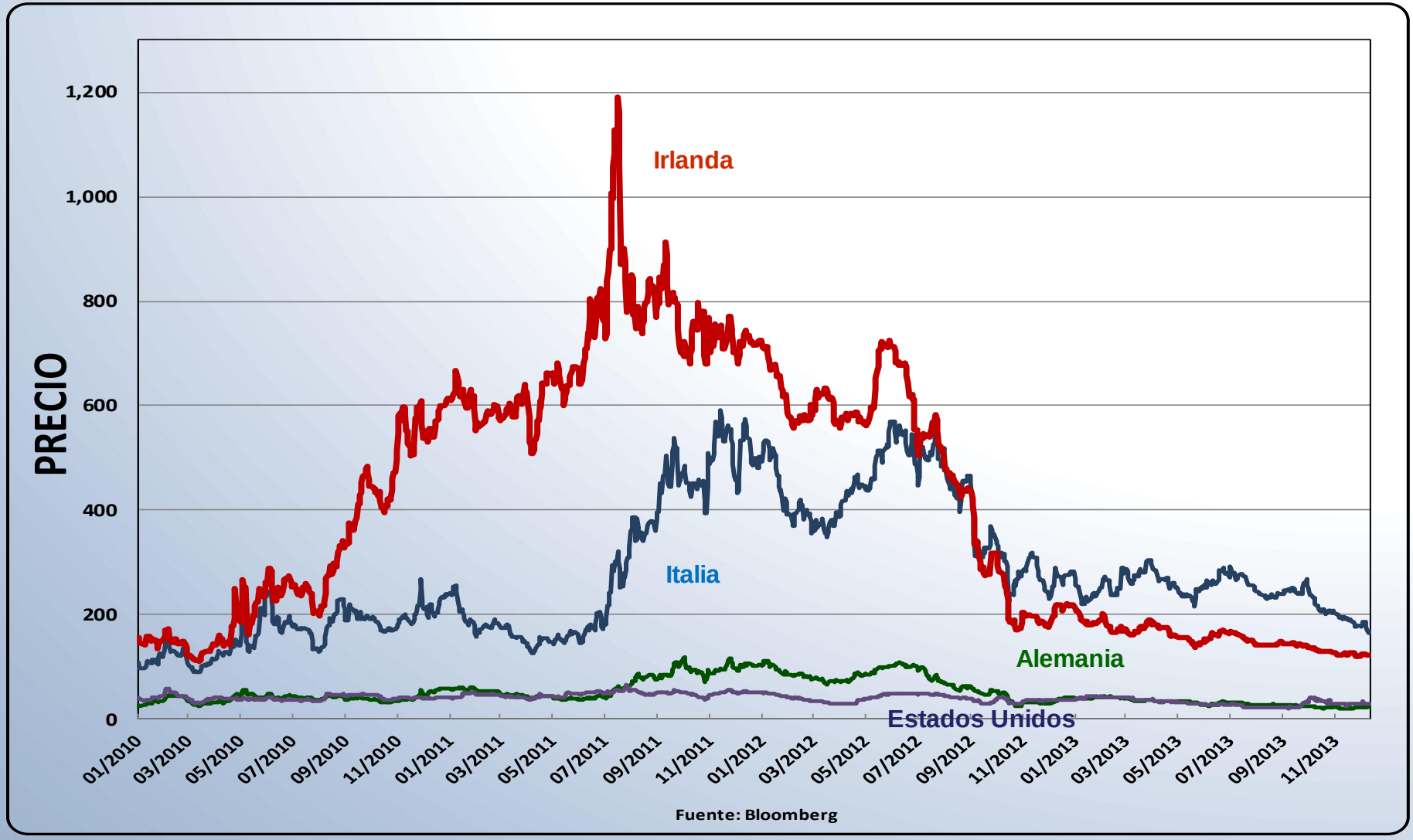
Credit Default Swaps

(Países de la Periferia de la Zona Euro)

-En puntos base-



Credit Default Swaps

(Países de la Periferia de la Zona Euro)

-En puntos base-