

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	19 Mayo 14	20 Mayo 14	21 Mayo 14	22 Mayo 14	23 Mayo 14
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>7,471.6</b>	<b>7,115.5</b>	<b>6,491.4</b>	<b>6,332.3</b>	<b>5,713.1</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas	100.0	200.0	200.0	100.0	500.1
Plazo de vencimiento	527.5	751.3	647.5	226.0	405.0
Tasas de interés	171 d	171 d	353 d	14 d	14 d
Mínima	3.65	3.70	3.75	3.73	3.73
Máxima	3.80	3.85	3.98	3.78	4.00
Promedio	3.72	3.82	3.93	3.76	3.85
Saldo		13,295.1		14,195.0	15,395.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Junio de 2014				450.0	450.0
Vencimientos de CD BCRP entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014				0.0	0.0
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Próximo vencimiento de Repo el 7 de Agosto de 2014.					
Vencimientos de REPO entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014			0.0	0.0	0.0
<b>vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)</b>		200.0	200.0		
Propuestas recibidas		200.0	308.0		
Plazo de vencimiento		62 d	62 d		
Tasas de interés		0.11	0.05		
Mínima		0.11	0.05		
Máxima		0.15	0.05		
Promedio		0.14	0.05		
Saldo	1,573.0	1,473.0	1,373.0	1,073.0	1,073.0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 27 de Mayo de 2014			300.0	163.0	163.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014			300.0	0.0	0.0
<b>vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)			100.0	100.0	100.0
Vencimientos de REPO entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014			0.0	0.0	0.0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>					
Tipo de cambio promedio					
<b>ii. Ventas (millones de US\$)</b>					
Tipo de cambio promedio					
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</b>					
<b>ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</b>					
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</b>					
<b>ii. Compras de BTP</b>					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>6,971.6</b>	<b>6,515.5</b>	<b>5,791.5</b>	<b>5,632.2</b>	<b>5,213.1</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</b>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0126%	0.0126%	0.0126%	0.0126%	0.0126%
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
<b>c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
<b>d. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>	2,707.8	1,867.3	1,154.6	352.3	1,503.7
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>4,263.8</b>	<b>4,648.2</b>	<b>4,636.9</b>	<b>5,279.9</b>	<b>3,709.4</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	11,812.5	11,812.5	12,139.2	12,079.3	11,900.9
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	13.0	13.0	13.3	13.3	13.1
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	7,430.1	6,920.1	6,811.4	6,751.5	6,573.1
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	7.1	7.1	7.5	7.4	7.2
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>	1,223.0	1,166.0	1,462.0	1,146.0	588.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,90/3,89	3,80/4,00/3,87	3,80/4,00/3,89	3,80/4,00/3,88	3,80/3,95/3,89
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	69.0	50.0	70.0	27.0	29.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,05/0,10/0,09	0,08/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,08/0,10/0,09	0,08/0,10/0,09
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>	17.0	75.5	40.0	50.0	52.5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		75.0 / 3,65			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			40.0 / 3,65		11.0 / 3,75
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>16 Mayo 2014</b>	<b>19 Mayo 2014</b>	<b>20 Mayo 2014</b>	<b>21 Mayo 2014</b>	<b>22 Mayo 2014</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	55.3	-39.9	-9.6	-123.1	-68.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	97.5	-12.0	-9.1	-119.1	-97.0
<b>a. Mercado spot con el público</b>	-58.7	-12.6	-46.6	-130.8	-32.1
<b>i. Compras</b>	310.2	252.7	290.8	204.8	312.5
<b>ii. (-) Ventas</b>	368.8	267.7	337.5	335.6	344.6
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	-103.5	-84.5	-2.2	-49.4	-68.4
<b>i. Pactadas</b>	170.9	227.3	206.0	257.6	117.4
<b>ii. (-) Vencidas</b>	274.4	311.8	208.2	307.0	185.8
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	-61.3	-106.3	-1.7	-45.4	-97.1
<b>i. Pactadas</b>	80.9	136.4	189.8	70.2	107.1
<b>ii. (-) Vencidas</b>	142.2	242.6	191.5	115.6	204.2
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>					
<b>i. Al contado</b>	946.3	457.1	854.0	872.5	466.1
<b>ii. A futuro</b>	128.0	130.0	95.0	30.0	40.0
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>	31.0	-9.0	86.9	-139.6	59.4
<b>i. Compras</b>	135.5	238.1	189.7	115.0	201.8
<b>ii. (-) Ventas</b>	104.5	247.1	102.8	254.7	142.4
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	-7.0	-109.7	-66.1	-40.1	-106.0
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7860	2,7877	2,7913	2,7888	2,7876
(*) Datos preliminares					