

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

|  | 6 Octubre 14          | 7 Octubre 14          | 9 Octubre 14          | 10 Octubre 14         |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>          | <b>4 041,6</b>        | <b>3 830,5</b>        | <b>3 066,7</b>        | <b>3 253,9</b>        |
| <b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>                      |                       |                       |                       |                       |
| a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR   |                       |                       |                       |                       |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)   |                       |                       |                       |                       |
| Propuestas recibidas   | 100,0                 |                       | 100,0                 |                       |
| Plazo de vencimiento   | 184,0                 |                       | 436,0                 |                       |
| Tasas de interés Mínima  | 185 d                 |                       | 371 d                 |                       |
| Máxima   | 3,51                  |                       | 3,50                  |                       |
| Promedio   | 3,75                  |                       | 3,64                  |                       |
| Saldo  | 3,70                  |                       | 3,63                  |                       |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Octubre de 2014  | 17 864,8              | 17 864,8              | 15 765,0              | 15 765,0              |
| Vencimientos de CD BCRP entre el 13 y el 17 de Octubre de 2014   |                       | 2 199,8               |                       | 230,1                 |
|  |                       | 2 199,8               |                       | 230,1                 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)   |                       |                       |                       |                       |
| Propuestas recibidas   | 1 000,0               | 2 200,0               | 1 000,0               | 1 614,0               |
| Plazo de vencimiento   | 2 955,0               | 2 960,0               | 3 005,0               | 1 714,0               |
| Tasas de interés Mínima  | 1 d                   | 1 d                   | 2 d                   | 2 d                   |
| Máxima   | 3,55                  | 3,50                  | 3,55                  | 3,52                  |
| Promedio   | 3,61                  | 3,58                  | 3,72                  | 3,60                  |
| Saldo  | 3,96                  | 3,55                  | 3,60                  | 3,58                  |
| Próximo vencimiento de Repo el 13 de Octubre de 2014   | 7 465,0               | 5 879,0               | 4 074,0               | 4 044,0               |
| Vencimientos de REPO entre el 13 y el 17 de Octubre de 2014  |                       | 5 014,0               |                       | 3 179,0               |
|  |                       | 5 014,0               |                       | 3 179,0               |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)                                  |                       |                       |                       |                       |
| Propuestas recibidas   |                       |                       |                       |                       |
| Plazo de vencimiento   |                       |                       |                       |                       |
| Tasas de interés Mínima  |                       |                       |                       |                       |
| Máxima   |                       |                       |                       |                       |
| Promedio   |                       |                       |                       |                       |
| Saldo  | 6 420,0               | 6 420,0               | 6 420,0               | 6 420,0               |
| Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 20 de Octubre de 2014                             |                       | 130,0                 |                       | 130,0                 |
| Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 13 y el 17 de Octubre de 2014                              |                       | 0,0                   |                       | 0,0                   |
| vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera   |                       |                       |                       |                       |
| Propuestas recibidas   |                       |                       |                       |                       |
| Plazo de vencimiento   |                       |                       |                       |                       |
| Tasas de interés Mínima  |                       |                       |                       |                       |
| Máxima   |                       |                       |                       |                       |
| Promedio   |                       |                       |                       |                       |
| Saldo  | 4 791,5               | 4 791,5               | 4 391,5               | 4 391,5               |
| Próximo vencimiento de Repo (3 de Noviembre de 2014)   |                       | 400,0                 |                       | 100,0                 |
| Vencimiento de REPO entre el 13 y el 17 de Octubre de 2014   |                       | 400,0                 |                       | 0,0                   |
| Subasta de Swap Cambiario venta del BCRP   |                       |                       |                       |                       |
| Propuestas recibidas   | 300,0                 | 300,0                 | 300,0                 | 300,0                 |
| Plazo de vencimiento   | 300,0                 | 300,0                 | 500,0                 | 377,0                 |
| Tasas de interés Mínima  | 64 d                  | 64 d                  | 63 d                  | 63 d                  |
| Máxima   | 0,00                  | 0,00                  | 0,05                  | 0,07                  |
| Promedio   | 0,13                  | 0,08                  | 0,09                  | 0,14                  |
| Saldo  | 0,06                  | 0,03                  | 0,07                  | 0,11                  |
| Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)   | 600,0                 | 900,0                 | 1 500,0               | 1 800,0               |
| Vencimiento de SC-Venta entre el 13 y el 17 de Octubre de 2014   |                       | 300,0                 |                       | 300,0                 |
|  |                       | 0,0                   |                       | 0,0                   |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR  | 0,0                   | -29,1                 | 0,0                   | 0,0                   |
| i. Compras (millones de US\$)  |                       |                       |                       |                       |
| Tipo de cambio promedio  |                       | 10,0                  |                       |                       |
| ii. Ventas (millones de US\$)  |                       | 2,9051                |                       |                       |
| c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)  | 0,0                   | 0,0                   | 0,0                   | 0,0                   |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público   |                       |                       |                       |                       |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público   |                       |                       |                       |                       |
| d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP                                       | 0,0                   | 0,0                   | 0,0                   | 0,0                   |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR   |                       |                       |                       |                       |
| ii. Compras de BTP   |                       |                       |                       |                       |
| <b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b> | <b>7 141,6</b>        | <b>6 415,5</b>        | <b>6 175,7</b>        | <b>6 432,9</b>        |
| <b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>                                     |                       |                       |                       |                       |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).   |                       |                       |                       |                       |
| Comisión (tasa efectiva diaria)  | 0,0121%               | 0,0112%               | 0,0121%               | 0,0121%               |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)   |                       |                       |                       |                       |
| Tasa de interés  | 4,30%                 | 4,30%                 | 4,30%                 | 4,30%                 |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional   |                       |                       |                       |                       |
| Tasa de interés  | 4,30%                 | 4,30%                 | 4,30%                 | 4,30%                 |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional  | 396,5                 | 394,9                 | 399,7                 | 460,0                 |
| Tasa de interés  | 2,30%                 | 2,30%                 | 2,30%                 | 2,30%                 |
| <b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>        | <b>6 745,1</b>        | <b>6 020,6</b>        | <b>5 776,0</b>        | <b>5 972,9</b>        |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)                            | 12 365,3              | 11 241,1              | 11 241,1              | 12 947,0              |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                 | 13,4                  | 12,2                  | 12,2                  | 12,7                  |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)                                   | 7 006,5               | 5 852,0               | 7 733,9               | 7 557,8               |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                    | 7,6                   | 6,3                   | 6,3                   | 7,4                   |
| <b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>   |                       |                       |                       |                       |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional   | 121,5                 | 175,5                 | 285,0                 | 613,0                 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   | 3,60/3,62/3,60        | 3,60/3,62/3,60        | 3,50/3,60/3,59        | 3,60/3,60/3,60        |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)  | 228,0                 | 281,5                 | 221,9                 | 230,4                 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   | 0,15/0,20/0,15        | 0,15/0,20/0,15        | 0,15/0,40/0,28        | 0,30/0,55/0,43        |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV   | 103,0                 | 0,0                   | 8,0                   | 0,0                   |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)  |                       |                       |                       |                       |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)   |                       |                       |                       |                       |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)   |                       |                       |                       |                       |
| <b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>                    | <b>3 Octubre 2014</b> | <b>6 Octubre 2014</b> | <b>7 Octubre 2014</b> | <b>9 Octubre 2014</b> |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f  | 8,7                   | 7,4                   | -74,1                 | 65,6                  |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f  | -38,3                 | -178,1                | -250,3                | 77,2                  |
| a. Mercado spot con el público   | -268,4                | -299,6                | -336,2                | -264,2                |
| i. Compras   | 344,2                 | 302,3                 | 327,8                 | 268,5                 |
| ii. (-) Ventas   | 612,6                 | 601,9                 | 664,0                 | 532,7                 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega)  | -2,8                  | -10,4                 | 35,7                  | -142,6                |
| i. Pactadas  | 240,6                 | 398,5                 | 227,0                 | 214,8                 |
| ii. (-) Vencidas   | 243,4                 | 408,9                 | 191,3                 | 357,5                 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega)   | -49,8                 | -195,8                | -37,2                 | 75,5                  |
| i. Pactadas  | 102,9                 | 294,7                 | 214,5                 | 506,8                 |
| ii. (-) Vencidas   | 152,8                 | 490,5                 | 251,8                 | 431,3                 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias   |                       |                       |                       |                       |
| i. Al contado  | 591,2                 | 496,5                 | 259,5                 | 190,2                 |
| ii. A futuro   | 100,2                 | 120,0                 | 50,0                  | 175,0                 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega                               | 72,6                  | 203,3                 | 116,2                 | 345,0                 |
| i. Compras   | 125,1                 | 485,4                 | 246,3                 | 424,6                 |
| ii. (-) Ventas   | 52,5                  | 282,1                 | 130,1                 | 79,6                  |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras   | 66,9                  | -0,2                  | 133,5                 | 276,8                 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera   |                       |                       |                       |                       |
| Tasa de interés  |                       |                       |                       |                       |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)  | 2,9039                | 2,9023                | 2,9041                | 2,9058                |
| (*) Datos preliminares   |                       |                       |                       |                       |