

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ											
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS											
(Millones de Nuevos Soles)											
	21 Mayo 14		22 Mayo 14			23 Mayo 14		26 Mayo 14		27 Mayo 14	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6 491,4		6 332,3			5 713,1		5 592,5		5 101,6	
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones											
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR											
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)											
Propuestas recibidas	100,0	399,9	100,0	100,0	500,1	500,0	100,0	1 000,0	100,0	599,5	
Plazo de vencimiento	381,8	812,0	226,0	405,0	1 020,0	940,0	333,3	1 173,0	228,3	601,0	
Tasas de interés Mínima	533 d	14 d	350 d	350 d	14 d	14 d	164 d	7 d	198 d	7 d	
Máxima	3,80	3,65	3,73	3,80	3,73	3,80	3,78	3,85	3,78	3,90	
Promedio	3,80	3,90	3,78	4,00	3,90	3,89	3,78	3,99	3,90	4,00	
Saldo	14 195,0		14 895,1			15 395,1		16 495,1		17 194,6	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Junio de 2014	450,0										
Vencimientos de CD BCRP del 21 al 23 de Mayo de 2014	0,0										
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)											
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.	100,0										
Vencimientos de REPO del 21 al 23 de Mayo de 2014	0,0										
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)											
Propuestas recibidas	200,0										
Plazo de vencimiento	308,0										
Tasas de interés Mínima	62 d										
Máxima	0,05										
Promedio	0,05										
Saldo	1 373,0		1 073,0			1 073,0		1 073,0		910,0	
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 21 de Mayo de 2014	163,0										
Vencimientos de Depósitos Reajustables del 21 al 23 de Mayo de 2014	0,0										
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera											
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										
Vencimientos de REPO del 21 al 23 de Mayo de 2014	0,0										
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0		0,0			0,0		0,0		0,0	
i. Compras (millones de US\$)											
Tipo de cambio promedio											
ii. Ventas (millones de US\$)											
Tipo de cambio promedio											
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0		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		0,0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR											
ii. Compras de BTP											
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	5 791,5		5 632,2			5 213,1		4 492,5		4 402,1	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones											
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)											
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%		0,0126%			0,0126%		0,0126%		0,0126%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)											
Tasa de interés	4,80%		4,80%			4,80%		4,80%		4,80%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional											
Tasa de interés	4,80%		4,80%			4,80%		4,80%		4,80%	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 154,6		352,3			1 503,7		91,9		365,3	
Tasa de interés	2,80%		2,80%			2,80%		2,80%		2,80%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 636,9		5 279,9			3 709,4		4 406,6		4 036,8	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 139,2		12 051,8			11 900,9		11 658,5		11 760,9	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,3		13,2			13,1		12,8		12,9	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 811,4		6 703,2			6 573,1		6 511,2		6 214,5	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5		7,4			7,2		6,9		7,1	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP											
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 462,0		1 146,0			588,0		967,0		1 219,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,80/4,00/3,89		3,80/4,00/3,88			3,80/3,95/3,89		3,80/3,95/3,84		3,80/3,90/3,83	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	70,0		27,0			29,0		9,0		9,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,10/0,10		0,08/0,10/0,09			0,08/0,10/0,09		0,08/0,08/0,08		0,07/0,07/0,07	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	40,0		50,0			52,5		76,0		93,0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	40,0 / 3,65		11,0 / 3,75			54,0 / 3,80		88,0 / 3,75			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)											
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)											
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Mayo 2014		21 Mayo 2014			22 Mayo 2014		23 Mayo 2014		26 Mayo 2014	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-9,6		-123,1			-68,4		76,5		38,0	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-9,1		-119,1			-97,0		-21,0		95,7	
a. Mercado spot con el público	-46,6		-130,8			-32,1		-78,8		38,0	
i. Compras	290,8		204,8			312,5		266,5		268,0	
ii. (-) Ventas	337,5		335,6			344,6		345,3		230,0	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-2,2		-49,4			-68,4		-15,5		-55,8	
i. Pactadas	206,0		257,6			117,4		130,4		44,4	
ii. (-) Vencidas	208,2		307,0			185,8		146,0		100,2	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-1,7		-45,4			-97,1		-113,0		1,8	
i. Pactadas	189,8		70,2			107,1		108,1		15,7	
ii. (-) Vencidas	191,5		115,6			204,2		221,1		13,9	
d. Operaciones cambiarias interbancarias											
i. Al contado	854,0		872,5			466,1		1324,2		246,2	
ii. A futuro	95,0		30,0			40,0		55,0		0,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	86,9		-139,6			59,4		135,0		-27,2	
i. Compras	189,7		115,0			201,8		218,8		13,4	
ii. (-) Ventas	102,8		254,7			142,4		83,9		40,6	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-66,1		-40,1			-106,0		-2,0		-1,5	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera											
Tasa de interés											
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7913		2,7888			2,7876		2,7862		2,7884	
(*) Datos preliminares											

d. = día(s) s. = semana(s) m. = mes(es) a. = año(s)

Tipo de Cambio, Cotizaciones, Tasas de Interés e Índices Bursátiles

		Dic-12 (b)	Dic-13 (p)	Abr-14 (q)	20-may (1)	27-may (2)	Variaciones respecto a:				
							Semana (2)/(1)	Mes (2)/(q)	Dic-13 (2)/(p)	Dic-12 (2)/(b)	
TIPOS DE CAMBIO											
AMÉRICA											
BRASIL	Real	2,05	2,36	2,23	2,22	2,24	1,0%	0,2%	-5,3%	9,3%	
ARGENTINA	Peso	4,92	6,52	8,00	8,06	8,06	0,0%	0,8%	23,7%	64,0%	
MÉXICO	Peso	12,86	13,03	13,08	12,91	12,85	-0,4%	-1,7%	-1,4%	-0,1%	
CHILE	Peso	478	525	564	552	555	0,6%	-1,6%	5,7%	16,1%	
COLOMBIA	Peso	1 766	1 929	1 935	1 921	1 916	-0,3%	-1,0%	-0,7%	8,5%	
PERÚ	N. Sol (Venta)	2,552	2,800	2,808	2,791	2,784	-0,3%	-0,9%	-0,6%	9,1%	
PERÚ	N. Sol x Canasta	0,50	0,54	0,54	0,53	0,53	-0,4%	-0,9%	-0,8%	6,7%	
EUROPA											
EURO	Euro	1,32	1,37	1,39	1,37	1,36	-0,5%	-1,7%	-0,8%	3,3%	
SUIZA	FS por euro	0,92	0,89	0,88	0,89	0,90	0,5%	1,9%	0,4%	-2,1%	
INGLATERRA	Libra	1,63	1,66	1,69	1,68	1,68	-0,2%	-0,4%	1,5%	3,4%	
TURQUÍA	Lira	1,78	2,15	2,11	2,11	2,10	-0,6%	-0,6%	-2,1%	18,1%	
ASIA Y OCEANÍA											
JAPÓN	Yen	86,74	105,30	102,24	101,31	101,97	0,7%	-0,3%	-3,2%	17,6%	
COREA	Won	1 063,24	1 055,25	1 032,75	1 025,00	1 023,00	-0,2%	-0,9%	-3,1%	-3,8%	
INDIA	Rupia	54,99	61,80	60,34	58,58	59,04	0,8%	-2,2%	-4,5%	7,4%	
CHINA	Yuan	6,23	6,05	6,26	6,24	6,25	0,2%	-0,2%	3,2%	0,3%	
AUSTRALIA	US\$ por AUD	1,04	0,89	0,93	0,92	0,93	0,2%	-0,3%	3,9%	-10,9%	
COTIZACIONES											
ORO	LME (\$/Oz.T.)	1 663,02	1 204,50	1 288,50	1 295,50	1 275,50	-1,5%	-1,0%	5,9%	-23,3%	
PLATA	H & H (\$/Oz.T.)	30,00	19,49	19,20	19,42	19,08	-1,8%	-0,7%	-2,1%	-36,4%	
COBRE	LME (US\$/b.)	3,59	3,35	3,05	3,14	3,18	1,4%	4,4%	-5,1%	-11,3%	
	Futuro a 15 meses	3,69	3,36	3,02	3,13	3,15	0,7%	4,3%	-6,2%	-14,5%	
ZINC	LME (US\$/b.)	0,92	0,95	0,93	0,94	0,94	0,0%	1,3%	-0,2%	2,3%	
	Futuro a 15 meses	0,97	0,95	0,93	0,95	0,95	0,5%	2,1%	0,5%	-1,9%	
PLOMO	LME (US\$/b.)	1,06	1,00	0,95	0,96	0,96	0,3%	1,5%	-3,9%	-9,4%	
	Futuro a 15 meses	1,07	1,02	0,96	0,97	0,98	0,5%	1,5%	-3,9%	-8,4%	
PETRÓLEO	West Texas (\$/B)	91,82	98,42	99,74	102,44	104,11	1,6%	4,4%	5,8%	13,4%	
PETR. WTI	Dic. 13 Bolsa de NY	93,37	92,72	94,93	97,57	98,90	1,4%	4,2%	6,7%	5,9%	
TRIGO SPOT	Kansas (\$/TM)	289,72	234,98	297,07	280,81	269,79	-3,9%	-9,2%	14,8%	-6,9%	
TRIGO FUTURO	Dic.13 (\$/TM)	320,22	245,91	301,94	288,53	277,87	-3,7%	-8,0%	13,0%	-13,2%	
MAÍZ SPOT	Chicago (\$/TM)	272,03	157,67	193,69	177,35	176,37	-0,6%	-8,9%	11,9%	-35,2%	
MAÍZ FUTURO	Dic. 13 (\$/TM)	236,11	177,26	200,48	185,82	183,36	-1,3%	-8,5%	3,4%	-22,3%	
ACEITE SOYA	Chicago (\$/TM)	1 033,09	806,23	937,41	886,04	877,66	-0,9%	-6,4%	8,9%	-15,0%	
ACEITE SOYA	Dic. 13 (\$/TM)	1 108,93	883,39	912,49	884,72	884,27	0,0%	-3,1%	0,1%	-20,3%	
AZÚCAR	May.13 (\$/TM)	430,12	365,09	380,08	380,08	380,08	0,0%	0,0%	4,1%	-11,6%	
ARROZ	Tailandés (\$/TM)	560,00	400,00	410,00	390,00	385,00	-1,3%	-6,1%	-3,8%	-31,3%	
TASAS DE INTERÉS (Variación en pbs.)											
SPR. GLOBAL 16	PER. (pbs)	57	62	31	54	47	-7	16	-15	-10	
SPR. GLOBAL 25	PER. (pbs)	107	134	118	129	126	-3	8	-8	19	
SPR. GLOBAL 37	PER. (pbs)	107	170	153	155	162	7	9	-8	55	
SPR. EMBIG	PER. (pbs)	114	162	149	153	155	2	6	-7	41	
	ARG. (pbs)	991	808	786	813	846	33	60	38	-145	
	BRA. (pbs)	140	230	217	221	221	0	4	-9	81	
	CHI. (pbs)	116	148	137	140	137	-3	0	-11	21	
	COL. (pbs)	112	163	157	162	156	-6	-1	-7	44	
	MEX. (pbs)	155	177	177	175	174	-1	-3	-3	19	
	TUR. (pbs)	177	310	236	225	230	5	-6	-80	53	
	ECO. EMERG. (pbs)	266	327	315	307	300	-7	-15	-27	35	
Spread CDS 5 (pbs)	PER. (pbs)	97	133	101	94	91	-3	-10	-42	-6	
	ARG. (pbs)	1 401	1 638	1 656	1 677	1 713	35	57	75	312	
	BRA. (pbs)	108	193	145	156	154	-2	9	-40	45	
	CHI. (pbs)	72	80	73	72	70	-2	-3	-9	-2	
	COL. (pbs)	96	118	95	89	85	-4	-10	-33	-11	
	MEX. (pbs)	97	92	83	79	76	-3	-7	-16	-21	
	TUR. (pbs)	131	244	199	190	186	-4	-13	-58	55	
LIBOR 3M (%)		0,31	0,25	0,22	0,23	0,23	0	1	0	-8	
Bonos del Tesoro Americano (3 meses)		0,04	0,07	0,03	0,03	0,03	0	0	0	-2	
Bonos del Tesoro Americano (2 años)		0,25	0,38	0,41	0,34	0,35	1	-7	0	10	
Bonos del Tesoro Americano (10 años)		1,76	3,03	2,65	2,51	2,52	0	-13	-1	76	
ÍNDICES DE BOLSA											
AMÉRICA											
E.E.U.U.	Dow Jones	13 104	16 577	16 581	16 374	16 676	1,8%	0,6%	0,6%	27,3%	
	Nasdaq Comp.	3 020	4 177	4 115	4 097	4 237	3,4%	3,0%	1,4%	40,3%	
BRASIL	Bovespa	60 952	51 507	51 627	52 366	52 172	-0,4%	1,1%	1,3%	-14,4%	
ARGENTINA	Merval	2 854	5 391	6 782	7 218	7 572	4,9%	11,6%	40,4%	165,3%	
MÉXICO	IPC	43 706	42 727	40 712	41 805	41 959	0,4%	3,1%	-1,8%	-4,0%	
CHILE	IGP	21 070	18 227	19 187	19 030	19 223	1,0%	0,2%	5,5%	-8,8%	
COLOMBIA	IGBC	14 716	13 071	13 626	13 473	13 637	1,2%	0,1%	4,3%	-7,3%	
PERÚ	Ind. Gral.	20 629	15 754	15 528	15 676	15 770	0,6%	1,6%	0,1%	-23,6%	
PERÚ	Ind. Selectivo	31 001	22 878	22 423	22 395	22 247	-0,7%	-0,8%	-2,8%	-28,2%	
EUROPA											
ALEMANIA	DAX	7 612	9 552	9 603	9 639	9 941	3,1%	3,5%	4,1%	30,6%	
FRANCIA	CAC 40	3 641	4 296	4 487	4 452	4 530	1,7%	0,9%	5,4%	24,4%	
REINO UNIDO	FTSE 100	5 898	6 749	6 780	6 802	6 845	0,6%	1,0%	1,4%	16,1%	
TURQUÍA	XU100	78 208	67 802	73 872	75 255	77 533	3,0%	5,0%	14,4%	-0,9%	
RUSIA	INTERFAX	1 530	1 442	1 156	1 299	1 298	-0,1%	12,3%	-10,0%	-15,2%	
ASIA											
JAPÓN	Nikkei 225	10 395	16 291	14 304	14 075	14 637	4,0%	2,3%	-10,2%	40,8%	
HONG KONG	Hang Seng	22 657	23 306	22 134	22 835	22 944	0,5%	3,7%	-1,6%	1,3%	
SINGAPUR	Straits Times	3 167	3 167	3 265	3 265	3 274	0,3%	0,3%	3,4%	3,4%	
COREA	Seul Composite	1 997	2 011	1 962	2 011	1 998	-0,7%	1,8%	-0,7%	0,0%	
INDONESIA	Jakarta Comp.	4 317	4 274	4 840	4 896	4 964	1,4%	2,6%	16,1%	15,0%	
MALASIA	KLSE	1 689	1 867	1 872	1 881	1 868	-0,7%	-0,2%	0,0%	10,6%	
TAILANDIA	SET	1 392	1 299	1 415	1 395	1 393	-0,1%	-1,6%	7,2%	0,1%	
INDIA	NSE	5 905	6 304	6 696	7 276	7 318	0,6%	9,3%	16,1%	23,9%	
CHINA	Shanghai Comp.	2 269	2 116	2 026	2 008	2 035	1,3%	0,4%	-3,8%	-10,3%	

Fuente: Reuters, Bloomberg, JPMorgan y Oryza y Creed Rice para el arroz.
Elaboración: Gerencia Central de Estudios Económicos - Subgerencia de Economía Internacional.

