

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	14 Abril	15 Abril	16 Abril
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>5,941.1</b>	<b>7,126.5</b>	<b>6,217.6</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 BCR (CD BCRP)		200.0	
Propuestas recibidas	50.0	100.0	50.0
Plazo de vencimiento	268.7	266.0	167.0
Tasas de interés Mínima	185 d	359 d	86 d
Máxima	3.45	3.47	3.45
Promedio	3.50	3.86	3.72
Saldo	3.49	3.68	3.62
Próximo vencimiento de CD BCRP el 8 de Mayo de 2014	<u>13,432.1</u>	<u>11,832.1</u>	<u>11,892.1</u>
Vencimientos de CD BCRP entre el 21 y el 25 de Abril de 2014			1,962.1
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)			0.0
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	<u>3,481.1</u>	<u>3,481.1</u>	<u>3,471.1</u>
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 21 de Abril de 2014			295.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 21 y el 25 de Abril de 2014			295.0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera			300.0
Propuestas recibidas			1,029.0
Plazo de vencimiento			548 d
Tasas de interés Mínima			4.45
Máxima			4.62
Promedio			4.51
Saldo	<u>600.0</u>	<u>600.0</u>	<u>900.0</u>
Próximo vencimiento de Repo (21 de Setiembre de 2015)			300.0
Vencimientos de REPO entre el 21 y el 25 de Abril de 2014			0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>
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\$)			
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>
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>5,891.1</b>	<b>6,826.5</b>	<b>6,467.6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0127%	0.0127%	0.0134%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>			
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>			
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	360.5	356.7	345.9
Tasa de interés	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>5,530.6</b>	<b>6,469.8</b>	<b>6,121.7</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12,578.2	12,578.2	12,578.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13.8	13.8	13.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7,432.7	6,879.8	7,432.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.1	8.1	8.1
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,222.8	1,110.0	1,185.7
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	4,00/4.05/4.01	4,00/4.15/4.06	4,00/4.40/4.24
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	208.0	227.0	186.0
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV.</u>	0.10/0.15/0.11	0.10/0.15/0.11	0.10/0.10/0.10
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			30.0 / 3.41
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>11 Abril 2014</b>	<b>14 Abril 2014</b>	<b>15 Abril 2014</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	112.9	-41.4	-97.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	16.5	-25.3	-40.0
a. <u>Mercado spot con el público.</u>	-125.7	-86.2	-63.3
i. Compras	297.6	423.5	534.4
ii. (-) Ventas	423.3	509.7	597.7
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	125.9	93.0	-459.7
i. Pactadas	338.9	293.4	288.0
ii. (-) Vencidas	212.9	200.4	747.7
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	29.6	109.1	-402.2
i. Pactadas	54.5	267.0	308.0
ii. (-) Vencidas	24.9	157.9	710.2
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>			
i. Al contado	721.3	707.6	591.0
ii. A futuro	15.0	152.0	232.0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-45.5	65.7	18.9
i. Compras	21.7	154.1	702.4
ii. (-) Ventas	67.2	88.4	683.6
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-0.4	-47.4	-33.0
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7848	2.7743	2.7748
(*) Datos preliminares			