

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
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7,471.6	7,115.5	6,491.4	6,332.3	5,713.1
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	100.0 200.0 200.0	200.0 200.0	100.0 399.9	100.0 100.0 500.1	500.0
Plazo de vencimiento	527.5 751.3 647.5	580.5 438.0	381.8 812.0	226.0 405.0 1 020.0	940.0
Tasas de interés Mínima	171 d 171 d 353 d	62 d 352 d	533 d 14 d	350 d 350 d 14 d	14 d
Máxima	3.65 3.70 3.75	3.70 3.90	3.80 3.65	3.73 3.80 3.73	3.80
Promedio	3.80 3.85 3.98	3.88 4.00	3.80 3.90	3.78 4.00 3.90	3.89
Saldo	3.72 3.82 3.93	3.84 3.99	3.80 3.80	3.76 3.98 3.85	3.87
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Junio de 2014			14,195.0	14,895.1	15,395.1
Vencimientos de CD BCRP entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014			450.0	450.0	450.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			0.0	0.0	0.0
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	100.0	100.0
Vencimientos de REPO entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014			0.0	0.0	0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		200.0	200.0		
Propuestas recibidas		200.0	308.0		
Plazo de vencimiento		62 d	62 d		
Tasas de interés 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
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	100.0	100.0
Vencimientos de REPO entre el 26 y el 30 de Mayo de 2014			0.0	0.0	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					
(millones de US\$)					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
(millones de US\$)					
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					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
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					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
ii. Compras de BTP					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	6,971.6	6,515.5	5,791.5	5,632.2	5,213.1
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	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%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4,263.8	4,648.2	4,636.9	5,279.9	3,709.4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11,812.5	11,812.5	12,139.2	12,079.3	11,900.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13.0	13.0	13.3	13.3	13.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7,430.1	6,920.1	6,811.4	6,751.5	6,573.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.1	7.1	7.5	7.4	7.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	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. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	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)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	16 Mayo 2014	19 Mayo 2014	20 Mayo 2014	21 Mayo 2014	22 Mayo 2014
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
a. Mercado spot con el público	-58.7	-61.6	-46.6	-130.8	-32.1
i. Compras	310.2	252.7	290.8	204.8	312.5
ii. (-) Ventas	368.8	264.7	337.5	335.6	344.6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-103.5	-84.5	-2.2	-49.4	-68.4
i. Pactadas	170.9	227.3	206.0	257.6	117.4
ii. (-) Vencidas	274.4	311.8	208.2	307.0	185.8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-61.3	-106.3	-1.7	-45.4	-97.1
i. Pactadas	80.9	136.4	189.8	70.2	107.1
ii. (-) Vencidas	142.2	242.6	191.5	115.6	204.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	946.3	457.1	854.0	872.5	466.1
ii. A futuro	128.0	130.0	95.0	30.0	40.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	31.0	-9.0	86.9	-139.6	59.4
i. Compras	135.5	238.1	189.7	115.0	201.8
ii. (-) Ventas	104.5	247.1	102.8	254.7	142.4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-7.0	-109.7	-66.1	-40.1	-106.0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7860	2,7877	2,7913	2,7888	2,7876
(*) Datos preliminares					