

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	7 Abril	8 Abril	9 Abril	10 Abril	11 Abril
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7,532.6	6,339.5	5,722.8	7,202.9	6,708.0
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	50.0		50.0	50.0	300.0
Plazo de vencimiento	374.5		273.0	400.6	433.3
Tasas de interés Mínima	192 d		554 d	364 d	91 d
Máxima	3.45		3.45	3.46	3.40
Promedio	3.50		3.51	3.49	3.83
Saldo	3.48		3.51	3.48	3.73
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Abril de 2014	14,722.5	14,722.5	14,722.5	13,082.1	13,382.1
Vencimientos de CD BCRP entre el 14 y el 16 de Abril de 2014		2,040.4			1,900.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500.0	500.0	500.0		1,900.0
Plazo de vencimiento	1,105.0	500.0	500.0		
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d		
Máxima	4.11	4.12	4.11		
Promedio	4.15	4.20	4.18		
Saldo	4.13	4.16	4.14		
Próximo vencimiento de Repo	2,000.0	1,000.0	500.0	0.0	0.0
Vencimientos de REPO		500.0			0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		1,000.0			0.0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3,481.1	3,481.1	3,481.1	3,481.1	3,481.1
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 16 de Abril de 2014		10.0			10.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 14 y el 16 de Abril de 2014		0.0			10.0
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	7,982.6	6,839.5	6,172.8	6,053.0	6,408.0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0125%	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	418.8	534.1	568.8	14.3	361.2
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	7,563.8	6,305.4	5,604.0	6,038.7	6,046.8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13,029.1	12,831.9	12,733.1	12,733.1	12,578.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14.3	14.1	14.0	14.0	13.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7,883.6	7,686.4	7,587.6	7,587.6	7,432.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.6	8.4	8.3	8.3	8.1
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,220.0	1,384.6	1,172.5	1,276.5	1,520.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,00/4.00	4,00/4,00/4.00	4,00/4,00/4.00	4,00/4,10/4.02	4,00/4,15/4.06
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	261.0	35.0	219.0	178.0	195.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	100.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	4 Abril 2014	7 Abril 2014	8 Abril 2014	9 Abril 2014	10 Abril 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	32.6	-51.9	-93.9	84.0	-15.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	21.2	48.1	-2.1	54.9	-115.9
a. Mercado spot con el público	-45.1	-131.4	-11.6	8.7	-141.1
i. Compras	371.8	343.3	308.5	331.8	322.0
ii. (-) Ventas	-416.9	-474.7	-320.1	-323.0	-463.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-147.3	-80.4	-73.6	110.0	-143.8
i. Pactadas	183.5	165.3	97.8	258.9	191.1
ii. (-) Vencidas	330.8	245.7	171.4	148.9	334.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-158.6	19.6	18.3	80.8	-243.9
i. Pactadas	21.5	168.4	235.9	170.4	85.1
ii. (-) Vencidas	180.2	148.8	217.6	89.6	329.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	819.9	870.1	1227.2	983.2	1111.0
ii. A futuro	85.0	180.0	137.0	105.0	180.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	42.0	84.1	62.9	-20.1	20.2
i. Compras	157.6	148.0	217.0	89.5	323.3
ii. (-) Ventas	115.7	63.9	154.1	109.6	303.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-126.2	-1.5	-7.1	6.9	-0.8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2.8086	2.8023	2.7893	2.7954	2.7852
(*) Datos preliminares					