

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	28 Abril 14	29 Abril 14	30 Abril 14	2 Mayo 14
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>5 966,1</b>	<b>6 051,7</b>	<b>5 567,8</b>	<b>5 651,9</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 BCR (CD BCRP)				
Propuestas recibidas	50,0	300,0	75,0	
Plazo de vencimiento	153,0	509,0	533,8	155,5
Tasas de interés: Mínima	171 d	73 d	345 d	345 d
Máxima	3,45	3,42	3,50	3,65
Promedio	3,56	3,77	3,84	3,86
Saldo	3,51	3,65	3,79	3,77
Próximo vencimiento de CD BCRP el 8 de Mayo de 2014	12 382,2	12 682,2	12 757,2	12 757,2
Vencimientos de CD BCRP entre el 5 y el 9 de Mayo de 2014		1 962,1		1 962,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 5 y el 9 de Mayo de 2014		0,0		1 962,1
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas	10,0			
Plazo de vencimiento	63 d			
Tasas de interés: Mínima	0,14			
Máxima	0,14			
Promedio	0,14			
Saldo	3 186,1	3 186,1	3 186,1	3 186,1
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 5 de Mayo de 2014		208,0		208,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 5 y el 9 de Mayo de 2014		0,0		300,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera				
Propuestas recibidas				1 034,0
Plazo de vencimiento				731 d
Tasas de interés: Mínima				4,80
Máxima				4,85
Promedio				4,83
Saldo	900,0	900,0	900,0	1 200,0
Próximo vencimiento de Repo (21 de Setiembre de 2015)		300,0		300,0
Vencimientos de REPO entre el 5 y el 9 de Mayo de 2014		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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
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>5 606,1</b>	<b>5 751,7</b>	<b>5 492,8</b>	<b>8 223,4</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)	0,0125%	0,0125%	0,0134%	0,0125%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	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%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	2 091,0	1 776,7	684,5	0,0
Tasa de interés	2,80%	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>3 515,1</b>	<b>3 975,0</b>	<b>4 808,3</b>	<b>8 223,4</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 273,1	11 379,4	11 137,7	11 658,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,3	12,5	12,2	13,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 317,8	6 237,1	5 965,2	6 515,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,8	6,6	7,7
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	1 846,0	1 318,0	1 186,0	207,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,05/4,01	4,00/4,05/4,01	4,00/4,25/4,04	4,00/4,25/4,20
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	64,5	77,0	65,0	141,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,10/0,10	0,05/0,10/0,09	0,10/0,10/0,10	0,10/0,15/0,11
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	16,0	100,0	10,0	5,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	16,0 / 3,50			
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>25 Abril 2014</b>	<b>28 Abril 2014</b>	<b>29 Abril 2014</b>	<b>30 Abril 2014</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	22,5	50,4	-55,2	137,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-38,0	-46,0	-155,1	23,4
a. <u>Mercado spot con el público</u>	-149,9	-161,4	-258,1	-164,0
i. Compras	604,7	239,0	305,5	418,4
ii. (-) Ventas	754,6	400,4	563,6	582,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	113,8	31,6	-97,7	-60,9
i. Pactadas	310,0	284,3	314,5	271,8
ii. (-) Vencidas	196,2	252,6	412,2	332,6
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	53,3	-64,7	-197,6	-175,2
i. Pactadas	77,5	162,9	118,5	177,3
ii. (-) Vencidas	24,2	227,6	316,1	352,5
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	809,9	707,3	936,5	821,1
ii. A futuro	35,0	62,0	35,0	25,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-53,4	80,7	18,6	222,3
i. Compras	23,3	226,8	194,5	334,5
ii. (-) Ventas	76,7	146,1	175,9	112,2
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-6,6	9,7	-11,7	-15,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8038	2,8082	2,8072	2,8078
(*) Datos preliminares				