

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
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 966,1	6 051,7	5 567,8	5 651,9
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	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				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	5 606,1	5 751,7	5 492,8	8 223,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
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%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 515,1	3 975,0	4 808,3	8 223,4
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
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
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)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	25 Abril 2014	28 Abril 2014	29 Abril 2014	30 Abril 2014
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				