

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	12 Mayo 14	13 Mayo 14	14 Mayo 14	15 Mayo 14	16 Mayo 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8 723,9	8 686,0	8 566,4	8 045,9	6 995,4
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	75,0 100,0 99,9	100,1 100,0 100,0	100,0 100,0 100,0	100,0 200,0 200,0	200,0 200,0
Plazo de vencimiento	411,7 420,0 349,3	223,4 487,9 401,6	410,0 436,5 450,5	465,0 363,0 706,0	781,4 616,0
Tasas de interés Mínima	178 d 360 d 178 d	86 d 177 d 359 d	540 d 85 d 176 d	357 d 175 d 357 d	174 d 356 d
Máxima	3,42 3,70 3,41	3,50 3,40 3,65	3,53 3,62 3,60	3,60 3,50 3,65	3,71 3,58
Promedio	3,42 3,70 3,77	3,95 3,45 3,80	3,53 3,85 3,72	3,70 3,99 3,69	3,82 3,84
Saldo	3,42 3,70 3,70	3,89 3,42 3,72	3,53 3,74 3,70	3,68 3,87 3,68	3,76 3,74
Saldo	11 295,0	11 595,1	11 895,1	12 395,1	12 795,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Junio de 2014	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 19 y el 23 de Mayo de 2014	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
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	100,0	100,0
Vencimientos de REPO entre el 19 y el 23 de Mayo de 2014	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 578,0	2 336,0	2 036,0	1 893,0	1 873,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 19 de Mayo de 2014	242,0	243,0	243,0	20,0	300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 19 y el 23 de Mayo de 2014	805,0	263,0	263,0	20,0	1 200,0
iv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 300,0	1 600,0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
Vencimientos de REPO entre el 19 y el 23 de Mayo de 2014	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	8 449,0	8 385,9	8 266,4	7 445,9	6 895,4
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	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	3,82,8	4,53,3	1 360,7	528,9	2 726,8
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%
Tasa de interés					
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	8 066,2	7 932,6	6 905,7	6 917,0	4 188,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 042,2	13 824,6	13 014,3	13 032,4	12 806,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,4	14,1	14,3	14,3	14,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio (millones de S/.)	7 714,4	7 746,5	7 686,4	7 704,6	7 479,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,5	8,7	8,5	8,5	8,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 050,8	1 027,0	1 673,0	1 247,9	743,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	3,90/4,00/4,00	3,75/4,00/3,88
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	113,5	121,5	133,0	125,0	100,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,100/10,0/10	0,100/12,0/10	0,100/10,0/10	0,100/10,0/10	0,100/10,0/10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	40,0	58,0	32,7	102,7	40,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	45,0 / 3,40		30,0 / 3,42	25,0 / 3,73	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	09 Mayo 2014	12 Mayo 2014	13 Mayo 2014	14 Mayo 2014	15 Mayo 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	56,0	-4,5	92,9	-35,1	-82,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	83,4	13,5	15,9	114,0	6,1
a. Mercado spot con el público	-32,9	-74,5	-93,1	9,8	-23,7
i. Compras	369,8	347,2	347,2	336,4	370,1
ii. (-) Ventas	402,8	323,9	410,3	327,7	393,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-22,9	-151,0	110,1	-113,8	51,3
i. Pactadas	124,6	136,7	367,5	301,1	186,8
ii. (-) Vencidas	147,6	287,7	257,5	415,0	135,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	4,5	-133,1	33,1	35,3	139,6
i. Pactadas	234,9	64,1	210,9	311,5	206,7
ii. (-) Vencidas	230,3	197,2	177,9	276,2	67,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1098,3	1091,0	617,0	946,7	1101,1
ii. A futuro	304,0	120,0	145,0	80,0	104,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	199,5	195,3	95,7	78,2	17,3
i. Compras	229,6	189,8	177,2	276,0	64,8
ii. (-) Ventas	30,1	84,6	91,5	197,7	47,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,3	-107,7	-86,3	-111,7	-55,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,7874	2,7840	2,7846	2,7845	2,7875
(*) Datos preliminares					