BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	2 Junio 14	3 Junio 14	4 Junio 14	5 Junio 14	6 Junio 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**5,498.6**	**6,207.3**	**6,822.8**	**7,517.7**	**7,984.2**
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)	100.0		100.0	100.0	
Propuestas recibidas	165.0		360.0	495.4	
Plazo de vencimiento	192 d		554 d	371 d	
Tasas de interés Mínima	3.84		3.92	3.87	
Máxima	3.84		4.00	3.95	
Promedio	3.84		3.96	3.90	
Saldo	16,494.6	15,895.1	15,595.2	15,195.1	14,695.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Junio de 2014			500.1	500.0	450.0
Vencimientos de CD BCRP entre el 9 y el 13 de Junio de 2014			1,000.1	500.0	450.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2,000.0	1,500.0	1,000.0	500.0	
Propuestas recibidas	3,100.0	3,500.0	2,200.0	900.0	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de interés Mínima	4.01	4.04	4.05	4.05	
Máxima	4.15	4.07	4.08	4.07	
Promedio	4.06	4.05	4.06	4.06	
Saldo		1,600.0	1,000.0	500.0	100.0
Próximo vencimiento de Repo el 7 de Agosto de 2014.			1,000.0	500.0	100.0
Vencimientos de REPO entre el 9 y el 13 de junio de 2014			1,000.0	500.0	0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	910.0	710.0	710.0	710.0	710.0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 30 de Junio de 2014			10.0	10.0	10.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 9 y el 13 de Junio de 2014			0.0	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	1,900.0	1,900.0	1,900.0	1,900.0	1,900.0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)			100.0	100.0	100.0
Vencimientos de REPO entre el 9 y el 13 de Junio 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$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)					
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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7,398.6**	**7,707.3**	**7,722.8**	**7,917.7**	**7,984.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0127%	0.0126%	0.0126%	0.0126%	0.0126%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5.0	2.0	97.0	84.0	468.0
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7,393.6**	**7,705.3**	**7,625.8**	**7,833.7**	**7,516.2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11,278.8	10,447.3	11,056.6	11,647.3	11,867.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12.4	11.3	11.9	12.6	12.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5,935.7	5,188.8	5,798.0	6,388.7	6,608.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.5	5.6	6.3	6.9	7.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	331.5	562.0	793.0	1,294.0	1,649.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,90/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	3,95/4,00/4,00	3,95/4,00/4,00	3,95/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	158.0	141.0	138.0	119.0	226.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,10/0,15/0,11	0,10/0,12/0,11	0,10/0,12/0,11	0,10/0,10/0,10	0,10/0,15/0,11
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	126.9	55.0	50.0	50.0	50.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	100,0 / 3,84				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					50,0 / 3,85
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**30 Mayo 2014**	**02 Junio 2014**	**03 Junio 2014**	**04 Junio 2014**	**05 Junio 2014**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-5.9	-15.3	-128.0	6.9	-82.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	39.8	239.1	25.0	68.4	23.1
a. Mercado spot con el público	-27.4	136.5	1.2	43.7	-68.0
i. Compras	336.3	312.0	205.4	217.1	202.1
ii. (-) Ventas	363.7	175.5	204.2	173.4	270.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-92.1	-34.6	-80.7	-80.1	-106.7
i. Pactadas	132.0	63.1	109.4	247.0	226.0
ii. (-) Vencidas	224.1	97.7	190.1	327.1	332.7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-46.4	219.8	72.2	-18.6	-1.3
i. Pactadas	211.3	395.9	245.2	127.7	238.6
ii. (-) Vencidas	257.7	176.1	172.9	146.3	240.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	740.8	365.6	486.6	452.0	384.3
ii. A futuro	33.0	30.0	119.0	260.0	95.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	106.2	174.1	79.7	-155.6	13.6
i. Compras	252.2	174.9	171.9	120.3	239.2
ii. (-) Ventas	146.0	0.8	92.3	275.9	225.6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5.5	7.0	-73.1	-0.5	-15.3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7659	2.7733	2.7784	2.7858	2.7849
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera