

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	11 Agosto 14	12 Agosto 14	13 Agosto 14	14 Agosto 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8 561,5	8 355,2	7 136,1	6 187,6
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	100,0		200,0	100,0
Plazo de vencimiento	435,0		506,0	321,0
Tasas de interés Mínima	185 d		120 d	547 d
Máxima	3,38		3,40	3,60
Promedio	3,58		3,58	3,66
Saldo	3,49		3,55	3,63
Saldo	15 684,7	15 684,7	15 984,7	16 284,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Setiembre de 2014		820,0		820,0
Vencimientos de CD BCRP del 18 al 23 de Agosto de 2014		0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	500,0	500,0	500,0	500,0
Próximo vencimiento de Repo el 9 de Octubre de 2014		400,0		400,0
Vencimientos de REPO del 18 al 23 de Agosto de 2014		0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de Depósitos				
Vencimientos de Depósitos entre el 4 y el 8 de agosto de 2014				
v. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 24 y el 25 de Julio de 2014	0,0	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	3 200,0	3 200,0	3 200,0	3 200,0
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)		400,0		400,0
Vencimiento de REPO del 18 al 23 de Agosto de 2014		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
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
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	8 461,5	8 355,2	6 836,1	5 887,6
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%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 464,3	1 256,0	455,0	478,7
Tasa de interés	2,55%	2,55%	2,55%	2,55%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	6 997,2	7 099,2	6 381,1	5 408,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 392,2	12 392,2	12 392,2	12 392,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,2	13,2	13,2	13,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 522,7	6 835,1	7 204,5	6 835,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,3	7,3	7,3	7,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 636,5	1 278,0	1 164,0	919,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,80/3,77	3,75/3,75/3,75	3,60/3,75/3,71	3,70/3,75/3,74
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	17,5	28,5	114,0	102,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,120,15/0,15	0,120,15/0,13	0,120,12/0,12	0,120,12/0,12
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	15,0	143,8	2,0	0,0
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\$)	08 Agosto 2014	11 Agosto 2014	12 Agosto 2014	13 Agosto 2014
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	33,0	-98,8	112,7	-92,2
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f	10,2	-166,1	358,1	-97,4
a. Mercado spot con el público	-115,9	-211,7	-222,7	-232,5
i. Compras	372,2	306,4	206,0	291,5
ii. (-) Ventas	488,1	518,2	428,6	524,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	10,8	103,3	-570,0	16,7
i. Pactadas	184,7	228,1	154,6	206,3
ii. (-) Vencidas	173,9	122,8	724,5	189,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-11,9	36,0	-324,7	21,5
i. Pactadas	233,0	248,4	181,0	144,7
ii. (-) Vencidas	244,8	212,4	505,7	123,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	1282,7	1491,0	1668,0	1545,9
ii. A futuro	150,0	230,0	65,0	305,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	190,0	130,1	357,8	79,0
i. Compras	242,8	182,6	500,6	121,2
ii. (-) Ventas	52,8	52,4	142,9	42,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	7,0	5,2	4,1	-0,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,8004	2,7891	2,7890	2,7947
(*) Datos preliminares				

d. = día(s)
s. = semana(s)
m. = mes(es)
a. = año(s)

15 Agosto 14
5 575,7
16 284,8
820,0
0,0
150,0
375,0
90,4
3,78
3,78
3,78
650,0
400,0
0,0
0,0
0,0
0,0
3 200,0
400,0
0,0
-27,9
10,0
2,7940
0,0
0,0
5 753,6
0,0126%
4,55%
4,55%
482,9
2,55%
5 270,7
12 382,2
13,2
6 835,1
7,3
1 293,0
3,75/3,80/3,77
188,7
0,12/0,12/0,12
195,0
195,0 / 3,52
14 Agosto 2014
65,7
84,1
47,0
399,9
352,9
-190,5
120,1
310,6
-172,1
226,5
398,6
1105,6
55,0
119,0
349,7
230,8
6,2
2,7937