

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	15 Setiembre 14	16 Setiembre 14	17 Setiembre 14	18 Setiembre 14	19 Setiembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	4 303,3	4 060,9	3 641,6	3 343,6	2 978,0
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 BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	100,0		100,0	100,0	0,0
Plazo de vencimiento	274,7		315,0	328,0	
Tasas de interés Mínima	178 d		540 d.	357 d.	
Máxima	3,40		3,55	3,45	
Promedio	3,60		3,60	3,51	
Saldo	3,54		3,58	3,47	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Octubre de 2014	16 964,8	16 964,8	17 064,8	17 164,8	17 164,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 22 y 26 de Setiembre de 2014			2 199,8		2 199,8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 000,0	300,0	1 000,0	1 400,1	1 500,0
Plazo de vencimiento	2 539,0	300,0	1 639,0	1 380,0	1 674,0
Tasas de interés Mínima	1 d	7 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	3,55	3,52	3,55	3,52	3,51
Promedio	3,60	3,52	3,57	3,57	3,54
Saldo	3,57	3,52	3,56	3,54	3,56
Próximo vencimiento de Repo el 22 de Setiembre de 2014	3 250,0	2 750,0	2 630,0	2 650,1	2 750,0
Vencimientos de REPO entre el 22 y 26 de Setiembre de 2014			1 380,0		1 800,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	295,0				300,0
Plazo de vencimiento	335,0				200,0
Tasas de interés Mínima	60 d				61 d
Máxima	0,00				0,01
Promedio	0,10				0,10
Saldo	0,03				0,04
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 20 de octubre de 2014	3 570,0	3 570,0	3 570,0	3 570,0	4 070,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 22 y 26 de Setiembre de 2014			130,0	130,0	130,0
vii. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas			0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de interés Mínima					0,0
Máxima					0,0
Promedio					0,0
Saldo					0,0
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)	4 400,0	4 400,0	4 400,0	4 400,0	4 400,0
Vencimiento de REPO entre el 22 y 26 de Setiembre de 2014			400,0	400,0	400,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación 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\$)					
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					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	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	6 208,3	5 560,9	4 921,6	4 643,7	3 978,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0123%	0,0123%	0,0123%	0,0123%	0,0123%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	508,7	498,4	503,6	499,2	502,1
Tasa de interés	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	5 899,6	5 062,5	4 418,0	4 144,5	3 475,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 729,8	11 708,8	11 608,9	11 536,2	11 414,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,5	12,5	12,4	12,3	12,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 202,6	6 132,4	6 031,5	5 968,6	5 837,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	6,5	6,4	6,4	6,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	240,0	945,0	656,0	740,0	723,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,60/3,52	3,50/3,50/3,50	3,50/3,55/3,53	3,50/3,50/3,50	3,50/3,55/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	14,3	44,8	105,9	117,3	238,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,12/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	5,0	116,3	15,0	10,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			50,0 / 3,40		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				15,0 / 3,45	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 Setiembre 2014	15 Setiembre 2014	16 Setiembre 2014	17 Setiembre 2014	18 Setiembre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	123,6	-21,2	36,0	39,2	3,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	147,1	73,6	-70,4	106,9	141,3
a. Mercado spot con el público	-89,0	-135,9	-245,4	-60,2	-151,6
i. Compras	470,7	346,5	274,0	274,4	225,2
ii. (-) Ventas	559,7	482,4	719,4	334,6	376,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	160,5	-160,5	113,0	5,9	-151,1
i. Pactadas	339,4	201,8	329,2	246,6	277,5
ii. (-) Vencidas	178,9	362,3	216,2	240,7	438,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	184,0	-59,7	6,5	73,6	-23,2
i. Pactadas	226,2	104,4	255,1	105,9	454,6
ii. (-) Vencidas	42,2	164,1	248,5	32,2	487,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	657,2	687,5	1157,4	693,0	598,6
ii. A futuro	130,2	60,0	185,0	163,0	134,2
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	6,5	-82,9	227,6	-46,1	342,0
i. Compras	39,9	158,7	242,2	31,3	482,2
ii. (-) Ventas	33,4	241,6	14,6	77,5	140,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	92,9	100,2	-20,3	4,7	0,0
g. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,8599	2,8606	2,8583	2,8601	2,8626
(*) Datos preliminares					