

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	3 Noviembre 14	4 Noviembre 14	5 Noviembre 14	6 Noviembre 14	7 Noviembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 464,3	2 687,6	2 417,1	3 649,9	1 769,0
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	
Plazo de vencimiento	241,0		222,0	466,6	
Tasas de interés Mínima	192,4		554,4	371,4	
Máxima	2,66		3,30	3,00	
Promedio	3,47		3,36	3,40	
Saldo	3,31		3,36	3,35	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Diciembre de 2014	16 535,0	16 535,0	16 635,0	14 735,1	14 735,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 10 y el 14 de Noviembre de 2014			1 999,9		1 000,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	3 500,1	3 800,0	3 900,0	2 000,0	3 812,0
Plazo de vencimiento	4 038,0	4 148,0	4 041,0	3 006,0	3 812,0
Tasas de interés Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4	3,4
Máxima	3,75	3,60	3,62	3,82	3,50
Promedio	3,91	3,87	3,81	3,82	3,75
Saldo	3,79	3,75	3,82	3,82	3,58
Próximo vencimiento de Repo el 10 de Noviembre de 2014	865,0	4 565,0	4 665,0	2 765,0	4 577,0
Vencimientos de Repo entre el 10 y el 14 de Noviembre de 2014			3 900,0		3 812,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	600,0	100,0	150,0		
Plazo de vencimiento	890,0	100,0	150,0		
Tasas de interés Mínima	64 d	64 d	64 d		
Máxima	0,01	0,07	0,02		
Promedio	0,08	0,07	0,12		
Saldo	0,06	0,07	0,08		
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 10 de Noviembre de 2014	5 505,0	5 415,0	5 455,0	5 455,0	5 455,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 10 y el 14 de Noviembre de 2014			745,0		745,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 291,5	4 291,5	4 291,5	4 291,5	4 291,5
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Diciembre de 2014			300,0		300,0
Vencimiento de REPO entre el 10 y el 14 de Noviembre de 2014			0,0		0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	600,0	300,0		299,9	173,5
Plazo de vencimiento	775,0	397,2		740,0	173,5
Tasas de interés Mínima	64 d	64 d		64 d	64 d
Máxima	0,00	0,01		0,00	0,00
Promedio	0,01	0,01		0,01	0,00
Saldo	0,01	0,01		0,01	0,00
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)	7 535,2	7 835,2	7 835,2	8 308,6	8 308,6
Vencimiento de SC-Venta entre el 10 y el 14 de Noviembre de 2014			300,0		300,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 10 y el 14 de Noviembre de 2014			0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-541,2	-585,5	-322,1	-732,9	-102,5
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	185,0	200,0	110,0	250,0	35,0
Tipo de cambio promedio	2,9255	2,9273	2,9281	2,9317	2,9275
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	5 723,2	5 892,4	5 745,0	4 816,0	5 478,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0120%
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 regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	10,0	10,0	10,0	507,1
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	5 723,2	5 792,4	5 735,0	4 806,0	4 971,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 684,4	11 185,2	9 343,3	9 628,0	9 942,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,9	13,8	9,9	10,2	10,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 513,4	3 291,6	3 780,3	4 280,5	4 379,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,1	7,1	4,0	4,3	4,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	817,5	373,0	528,2	1 077,5	609,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	3,60/3,85/3,76	3,80/3,85/3,81	3,80/3,85/3,80	3,50/3,60/3,69	3,50/3,60/3,51
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	156,5	75,9	46,8	24,4	3,9
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,10/0,15/0,14	0,10/0,10/0,10
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	5,0	70,0	7,5	147,5	30,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		30,0 / 3,30		55,0 / 3,25	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 Octubre 2014	03 Noviembre	04 Noviembre	05 Noviembre	06 Noviembre
Flujo de la posición alfab = a + b.i - c.j + e + f	371,0	-57,9	-13,4	-115,6	233,4
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.j + e + f	267,9	166,6	162,7	165,6	141,8
a. Mercado spot con el público	-49,6	-224,5	-29,8	-8,7	-227,2
i. Compras	380,6	218,1	208,9	424,8	241,4
ii. (-) Ventas	430,3	442,6	236,6	433,5	468,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-66,8	-154,6	-88,6	72,1	8,0
i. Pactadas	194,5	261,3	179,4	281,2	324,3
ii. (-) Vencidas	261,3	415,9	268,0	209,1	316,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	223,4	275,0	190,0	353,3	77,9
i. Pactadas	482,7	583,0	443,5	374,2	393,5
ii. (-) Vencidas	259,2	308,0	253,4	20,9	315,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1306,3	665,5	866,9	1291,9	1220,2
ii. A futuro	10,0	130,0	157,0	110,0	70,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	196,4	103,9	10,5	-128,0	120,9
i. Compras	254,6	282,1	245,1	20,8	309,6
ii. (-) Ventas	58,2	178,2	234,6	148,8	188,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	512,4	384,3	269,9	114,2	408,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9237	2,9253	2,9280	2,9285	2,9317
(*) Datos preliminares					