

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	26 Mayo 14	27 Mayo 14	28 Mayo 14	29 Mayo 14	30 Mayo 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5,592.5	5,101.6	4,435.0	4,197.3	4,185.1
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 1 000.0	100.0 599.5	100.0 171.5	100.0	100.0
Plazo de vencimiento	333.3 1 173.0	228.3 601.0	181.0 176.5	328.5	328.5
Tasas de interés	164 d 7 d	198 d 7 d	526 d 5 d	343 d	343 d
Mínima	3.78 3.85	3.78 3.90	3.90 3.95	3.90	3.90
Máxima	3.78 3.99	3.90 4.00	4.15 3.99	4.00	4.00
Promedio	3.78 3.96	3.82 3.95	3.91 3.96	3.95	3.95
Saldo	16,495.1	17,194.6	17,466.1	17,566.1	17,566.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Junio de 2014	1,000.0		1,000.0	1,171.5	1,171.5
Vencimientos de CD BCRP entre el 29 y el 30 de Mayo de 2014	0.0		0.0	0.0	3,171.0
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
Vencimientos de REPO entre el 29 y el 30 de Mayo de 2014	0.0		0.0	0.0	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	1,073.0	910.0	910.0	910.0	910.0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 3 de Junio de 2014	163.0		200.0	200.0	200.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 29 y el 30 de Mayo de 2014	163.0		0.0	0.0	200.0
vi. Cuenta con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,900.0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)	100.0		100.0	100.0	300.0
Vencimientos de REPO entre el 29 y el 30 de Mayo de 2014	0.0		0.0	0.0	648.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	-27.6	0.0
i. Compras (millones de US\$)				10.0	
Tipo de cambio promedio				2,7595	
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	4,492.5	4,402.1	4,163.5	4,124.9	4,485.1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0126%	0.0126%	0.0127%	0.0127%	0.0127%
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	91.9	209.7	1,555.2	1,500.6	1,500.6
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	4,400.6	4,402.1	3,953.8	2,569.7	2,984.5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11,655.0	11,760.9	11,459.0	11,336.2	11,278.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12.8	12.9	12.6	12.4	12.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6,327.1	6,214.5	6,133.7	6,010.9	5,953.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.9	7.1	6.7	6.6	6.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	967.0	1,219.0	1,373.5	1,382.5	791.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,80/3,95/3,84	3,80/3,90/3,83	3,80/3,90/3,83	3,80/3,95/3,87	4,00/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	9.0	9.0	5.0	9.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,08/0,08/0,08	0,07/0,07/0,07	0,07/0,07/0,07	0,05/0,05/0,05	5.0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	76.0	93.0	49.0	66.0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		88.0 / 3.75	39.0 / 3.75		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	54.0 / 3.80			50.0 / 3.80	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 Mayo 2014	26 Mayo 2014	27 Mayo 2014	28 Mayo 2014	29 Mayo 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	76.3	38.0	34.0	2.0	-42.9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-21.2	95.7	-71.5	62.0	-159.5
a. Mercado spot con el público	-79.0	38.0	-14.5	-125.1	-186.5
i. Compras	266.3	268.0	387.3	226.0	241.5
ii. (-) Ventas	345.3	230.0	401.8	351.1	428.0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-15.5	-55.8	33.8	37.1	65.2
i. Pactadas	130.4	44.4	160.8	362.7	238.1
ii. (-) Vencidas	146.0	100.2	127.0	325.6	173.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-113.0	1.8	-71.7	97.1	-51.5
i. Pactadas	108.1	15.7	52.1	394.6	144.3
ii. (-) Vencidas	221.1	13.9	123.7	297.5	195.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1324.2	246.2	900.0	1391.9	1338.4
ii. A futuro	55.0	0.0	30.0	65.0	68.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	135.0	-27.2	13.1	180.7	67.5
i. Compras	218.8	13.4	121.8	297.3	195.6
ii. (-) Ventas	83.9	40.6	108.8	116.6	128.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2.0	-1.8	-73.4	-21.8	-17.8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7862	2,7884	2,7852	2,7734	2,7590
(*) Datos preliminares					