

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	30 Julio 14	31 Julio 14	1 Agosto 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 921,3	6 352,4	5 958,7
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	100,0	
Plazo de vencimiento	279,0	400,0	
Tasas de interés Mínima	526 d	343 d	
Máxima	3,69	3,63	
Promedio	3,69	3,68	
Saldo	16 294,8	16 394,8	16 494,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Agosto de 2014	1 110,1		1 110,1
Vencimientos de CD BCRP entre 4 y el 8 de Agosto de 2014	0,0		1 110,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas			100,0
Plazo de vencimiento			200
Tasas de interés Mínima			94 d
Máxima			3,78
Promedio			3,78
Saldo	500,0	500,0	2 700,0
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Agosto de 2014	100,0		2 100,0
Vencimientos de REPO entre el 4 y el 8 de Agosto de 2014	0,0		2 200,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas	2 400,0	3 200,1	
Plazo de vencimiento	3 772,0	4 669,0	
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	
Máxima	2,99	2,75	
Promedio	3,15	3,05	
Saldo	2 400,0	3 200,1	
Próximo vencimiento de Depósitos	2 400,0	3 200,1	
Vencimientos de Depósitos entre el 4 y el 8 de agosto de 2014	2 400,0		
vi. 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
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR	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
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera			
Propuestas recibidas			100,0
Plazo de vencimiento			275,6
Tasas de interés Mínima			94 d
Máxima			3,86
Promedio			3,75
Saldo	3 200,0	3 200,0	3 300,0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)	100,0		100,0
Vencimiento de REPO entre el 4 y el 8 de Agosto de 2014	0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			
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
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
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 421,3	3 052,4	8 258,7
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%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	880,4	1 038,3	0,0
Tasa de interés	2,80%	2,80%	2,80%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 540,9	2 014,1	8 258,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 179,7	11 406,7	13 334,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,8	12,1	13,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 104,3	6 017,0	8 258,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,5	6,7	8,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	674,5	1 079,0	635,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,70/3,80/3,76	3,25/3,75/3,71	3,70/3,85/3,77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	30,0	42,5	117,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,12/0,12/0,12	0,12/0,12/0,12	0,12/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV	0,0	0,0	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\$)	25 Julio 2014	30 Julio 2014	31 Julio 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	109,5	-87,0	-46,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	89,6	-77,9	-8,0
a. Mercado spot con el público	-30,2	-152,1	-73,5
i. Compras	355,9	266,3	372,1
ii. (-) Ventas	386,0	418,4	445,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	3,6	536,3	4,9
i. Pactadas	207,5	718,6	298,8
ii. (-) Vencidas	203,9	182,2	293,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-16,3	545,4	43,4
i. Pactadas	169,8	841,8	256,7
ii. (-) Vencidas	186,1	296,4	213,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	1044,5	1370,3	1370,3
ii. A futuro	60,0	60,0	55,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	102,4	208,4	-18,3
i. Compras	182,1	294,3	212,0
ii. (-) Ventas	79,7	85,9	230,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,4	-20,0	3,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datafec)	2,7853	2,7902	2,7975

(*) Datos preliminares

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