

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	4 Agosto 14	5 Agosto 14	6 Agosto 14	7 Agosto 14	8 Agosto 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6 543,1	6 735,5	7 023,8	7 467,0	7 358,4
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	100,0	0,0
Plazo de vencimiento	344,0		316,1	551,5	
Tasas de interés	1 d		554 d.	371 d.	
Mínima	3,55		3,59	3,37	
Máxima	3,61		3,64	3,45	
Promedio	3,60		3,63	3,43	
Saldo	16 494,8	16 494,8	16 594,8	15 584,7	15 584,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Setiembre de 2014		1 110,1		820,0	820,0
Vencimientos de CD BCRP del 11 al 15 de Agosto de 2014		1 110,1		0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 500,0	1 000,0	800,0	300,0	800,0
Propuestas recibidas	1 850,0	1 390,0	1 190,0	600,0	1 215,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés	3,77	3,79	3,80	3,82	3,86
Mínima	3,80	3,82	3,81	3,82	3,86
Máxima	3,79	3,80	3,80	3,82	3,86
Promedio	2 100,0	1 600,0	1 400,0	800,0	1 300,0
Saldo		1 000,0		300,0	800,0
Próximo vencimiento de Repo el 8 de Agosto de 2014		1 100,0		300,0	300,0
Vencimientos de REPO del 11 al 15 de Agosto de 2014					
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					
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	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR	0,0	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	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 300,0	3 300,0	3 300,0	3 200,0	3 200,0
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)		100,0		400,0	400,0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de Agosto de 2014		100,0		0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación 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\$)	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	7 943,1	7 735,5	7 723,8	7 667,0	8 158,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,55%	4,55%	4,55%
c. Crédito por reposición monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,55%	4,55%	4,55%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	394,5	454,4	452,2	451,0	2 070,2
Tasa de interés	2,80%	2,80%	2,55%	2,55%	2,55%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	7 548,6	7 281,1	7 271,6	7 216,0	6 088,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 563,9	13 618,0	13 368,5	13 376,0	12 392,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,0	14,5	14,3	14,3	13,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 255,8	8 060,9	7 919,4	7 818,9	6 835,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	8,6	8,4	8,4	7,3
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	801,0	1 180,0	1 406,0	1 277,0	1 370,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,80/3,77	3,75/3,80/3,76	3,75/3,80/3,77	3,75/3,80/3,78	3,75/3,80/3,78
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	53,5	145,5	87,0	82,5	82,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,120/1,20/1,2	0,120/1,50/1,4	0,120/1,5/0,13	0,120/1,20/1,2	0,120/1,20/1,2
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	92,1	23,0/3,60	58,0	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\$)	01 Agosto 2014	04 Agosto 2014	05 Agosto 2014	06 Agosto 2014	07 Agosto 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-75,4	101,5	-67,4	32,6	77,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-34,2	-18,5	-56,9	53,2	20,7
a. Mercado spot con el público	-84,3	-83,0	-132,4	-5,2	-108,9
i. Compras	257,4	213,5	320,1	281,2	291,5
ii. (-) Ventas	341,7	296,5	452,5	286,3	400,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	80,0	168,6	41,6	-68,6	-21,6
i. Pactadas	223,0	328,9	352,4	290,0	328,8
ii. (-) Vencidas	143,0	158,3	310,8	358,6	350,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	121,1	48,5	52,1	-48,1	-78,8
i. Pactadas	170,8	164,8	279,5	273,4	374,5
ii. (-) Vencidas	49,7	116,2	227,4	321,5	453,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	886,2	1004,0	1131,6	853,0	1037,5
ii. A futuro	120,0	253,0	185,0	130,0	130,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-40,3	10,3	0,4	33,5	224,0
i. Compras	49,5	115,1	200,4	321,0	453,1
ii. (-) Ventas	89,8	104,8	200,0	287,6	229,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,0	12,1	-8,3	-12,3	8,5
g. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7966	2,8023	2,8129	2,8105	2,8100
(*) Datos preliminares					

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