

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	1 Setiembre 14	2 Setiembre 14	3 Setiembre 14	4 Setiembre 14	5 Setiembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 823,0	3 652,5	3 473,8	3 601,4	3 633,2
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	100,0	100,0
Plazo de vencimiento	330,5	120,0	350,2	350,2	350,2
Tasas de interés Mínima	192 d	554 d	371 d	371 d	371 d
Máxima	3,54	3,75	3,65	3,65	3,65
Promedio	3,65	3,75	3,72	3,72	3,72
Saldo	3,62	3,75	3,70	3,70	3,70
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Setiembre de 2014	17 184,8	17 184,8	17 284,8	17 384,8	17 384,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 8 y el 12 de Setiembre de 2014	820,0	820,0	820,0	820,0	820,0
ii. Subasta de Compras Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	3 000,0	3 200,0	3 500,0	3 400,0	3 200,0
Plazo de vencimiento	4 268,0	4 413,0	4 388,0	4 588,0	4 488,0
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	3,81	3,81	3,78	3,80	3,77
Promedio	3,86	3,87	3,88	3,88	3,91
Saldo	3,82	3,84	3,82	3,81	3,83
Próximo vencimiento de Repo el 8 de Setiembre de 2014	3 650,0	3 850,0	4 150,0	4 050,0	3 850,0
Vencimientos de REPO entre el 8 y el 12 de Setiembre de 2014	400,0	400,0	350,0	350,0	320,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de Depósitos entre el 5 de Setiembre de 2014	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	300,0	300,0	190,0	110,0	110,0
Plazo de vencimiento	430,0	310,0	190,0	110,0	110,0
Tasas de interés Mínima	63 d	63 d	63 d	62 d	62 d
Máxima	0,03	0,05	0,05	0,07	0,07
Promedio	0,05	0,05	0,15	0,10	0,10
Saldo	0,04	0,02	0,11	0,08	0,08
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 20 de octubre de 2014	1 930,0	2 120,0	2 120,0	2 230,0	2 230,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 8 y el 12 de Setiembre de 2014	130,0	130,0	130,0	130,0	130,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 200,0	3 200,0	3 200,0	3 500,0	3 800,0
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)	400,0	400,0	400,0	400,0	400,0
Vencimiento de REPO entre el 8 y el 12 de Setiembre de 2014	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	6 123,0	6 562,5	6 873,8	7 091,4	7 133,2
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	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
c. Crédito por liquidez monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	10,0	10,0	409,6	408,0	451,5
Tasa de interés	2,55%	2,55%	2,55%	2,55%	2,55%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	6 113,0	6 552,5	6 464,2	6 683,4	6 681,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 697,6	11 611,4	11 607,5	11 997,8	12 015,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,4	14,7	12,9	12,9	12,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 621,1	6 113,0	6 230,1	6 376,6	6 437,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,1	7,6	6,6	6,9	6,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	250,0	438,0	488,0	551,0	494,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,85/3,80	3,75/3,85/3,81	3,75/3,85/3,77	3,75/3,80/3,76	3,75/3,80/3,77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	130,0	105,0	95,8	41,3	84,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,12/0,15/0,15	0,12/0,15/0,14	0,12/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	51,5	0,0	80,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				20,0 / 3,65	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	29 Agosto 2014	1 Setiembre 2014	2 Setiembre 2014	3 Setiembre 2014	4 Setiembre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	99,3	49,6	-21,0	-156,1	38,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	61,3	-37,3	105,6	-135,3	27,2
a. Mercado spot con el público	-345,5	-339,5	-184,5	-342,7	-188,4
i. Compras	341,1	218,2	348,5	251,0	312,6
ii. (-) Ventas	686,6	567,8	513,1	593,7	481,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-10,5	159,0	-28,6	94,7	-210,6
i. Factadas	482,8	255,1	328,5	430,6	178,9
ii. (-) Vencidas	493,3	96,1	357,1	336,0	390,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-48,4	72,2	98,1	115,4	-221,8
i. Factadas	167,3	72,5	307,4	342,8	164,9
ii. (-) Vencidas	215,7	0,4	209,3	227,4	386,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	818,2	232,7	547,5	502,9	368,4
ii. A futuro	46,0	0,0	181,0	135,0	130,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	29,0	-10,7	63,9	85,6	145,0
i. Compras	102,1	0,2	208,2	212,0	386,5
ii. (-) Ventas	73,1	10,9	144,2	126,4	241,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	100,2	217,2	58,5	13,2	46,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8440	2,8507	2,8527	2,8498	2,8540
(*) Datos preliminares					