

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	8 Setiembre 14	9 Setiembre 14	10 Setiembre 14	11 Setiembre 14	12 Setiembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	4 137,0	4 944,3	4 171,1	4 693,3	4 138,8
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	
Plazo de vencimiento	294,4		231,5	334,2	
Tasas de interés Mínima	185 d		547 d	364 d	
Máxima	3,63		3,70	3,58	
Promedio	3,70		3,75	3,58	
Saldo	17 484,8	17 484,8	17 584,8	16 864,8	16 864,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Octubre de 2014			820,0	2 199,8	2 199,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 15 y el 19 de Setiembre de 2014			820,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 800,0	1 950,0	2 100,0	1 500,0	300,0
Plazo de vencimiento	2 348,0	3 158,0	3 238,0	2 330,0	2 425,0
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3,83	3,82	3,83	3,78	3,55
Promedio	3,86	3,88	3,86	3,85	3,79
Saldo	3,84	3,83	3,84	3,81	3,71
Próximo vencimiento de Repo el 15 de Setiembre de 2014	2 450,0	2 600,0	2 750,0	2 150,0	2 950,0
Vencimientos de REPO entre el 15 y el 19 de Setiembre de 2014			2 100,0	1 500,0	2 000,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		300,0	300,0	145,0	300,0
Plazo de vencimiento		665,0	430,0	145,0	530,0
Tasas de interés Mínima		62 d	62 d	62 d	61 d
Máxima		0,01	0,15	0,01	0,00
Promedio		0,01	0,15	0,07	0,15
Saldo	2 230,0		2 975,0	2 975,0	3 275,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 20 de octubre de 2014			130,0	130,0	130,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 15 y el 19 de Setiembre de 2014			0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas	300,0				300,0
Plazo de vencimiento	522,5				488,4
Tasas de interés Mínima	92 d				91 d
Máxima	3,71				3,75
Promedio	3,84				3,85
Saldo	3,73				3,75
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)	4 100,0	4 100,0	4 100,0	4 100,0	4 400,0
Vencimiento de REPO entre el 15 y el 19 de Setiembre de 2014			400,0	400,0	400,0
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	6 137,0	6 149,3	6 171,1	6 093,3	6 438,8
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 regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	462,4	461,7	471,6	508,8	511,7
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	5 674,6	5 687,6	5 699,5	5 684,5	5 927,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S./1 (*)	11 950,5	11 950,5	11 944,8	11 964,9	11 838,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,8	12,8	12,8	12,6	12,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S./1)	6 499,0	6 441,6	6 367,4	6 287,5	6 261,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,8	6,8	6,7	6,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	290,0	290,0	545,0	1 140,0	448,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,75/3,80/3,80	3,75/3,80/3,80	3,80/3,85/3,81	3,75/3,85/3,82	3,50/3,75/3,66
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	31,0	31,0	25,6	9,5	48,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,12/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	5,0	5,0	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\$)	5 Setiembre 2014	8 Setiembre 2014	9 Setiembre 2014	10 Setiembre 2014	11 Setiembre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-79,7	-59,3	312,8	-72,3	-120,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	63,3	27,2	154,7	-107,0	-50,4
a. Mercado spot con el público	-12,8	-173,9	-263,0	-233,5	-252,1
i. Compras	334,5	181,2	306,2	271,9	211,3
ii. (-) Ventas	347,4	355,2	569,1	505,4	463,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	106,3	-47,1	-41,7	81,8	-201,3
i. Pactadas	274,4	272,1	344,2	265,0	263,4
ii. (-) Vencidas	168,1	319,3	302,5	183,2	464,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	249,3	39,3	-116,4	47,0	-131,2
i. Pactadas	295,3	123,8	109,9	292,7	89,8
ii. (-) Vencidas	46,0	84,5	226,3	215,7	219,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	649,8	552,4	923,0	653,2	619,3
ii. A futuro	50,0	67,0	190,0	135,0	185,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-45,7	-39,5	87,2	161,5	-37,6
i. Compras	42,2	79,5	225,8	208,2	219,3
ii. (-) Ventas	87,8	119,0	138,6	46,8	256,9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,3	5,9	254,3	-2,6	-5,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8482	2,8522	2,8571	2,8541	2,8553
(*) Datos preliminares					