

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	20 Octubre 14	21 Octubre 14	22 Octubre 14	23 Octubre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 878,4	2 248,3	2 217,8	2 185,3
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
Plazo de vencimiento	369,5		319,5	442,0
Tasas de interés Mínima	171 d		533 d	357 d
Máxima	3,40		3,45	3,35
Promedio	3,46		3,46	3,44
Saldo	15 935,0	15 935,0	16 035,0	16 135,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Noviembre de 2014			1 999,9	1 999,9
Vencimientos de CD BCRP el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	500,0	2 000,0	1 900,0	1 700,0
Plazo de vencimiento	7d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés Mínima	3,57	3,52	3,51	3,50
Máxima	3,57	3,56	3,55	3,50
Promedio	3,57	3,55	3,51	3,50
Saldo	3 365,0	3 265,0	3 065,0	2 465,0
Próximo vencimiento de Repo el 24 de Octubre de 2014			1 700,0	1 100,0
Vencimientos de REPO el 24 de Octubre de 2014			1 700,0	1 100,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 290,0	6 290,0	6 290,0	6 290,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 27 de Octubre de 2014			600,0	600,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 391,5	4 391,5	4 391,5	4 391,5
Próximo vencimiento de Repo (3 de Noviembre de 2014)			100,0	100,0
Vencimiento de REPO el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 630,1	2 630,1	2 630,1	2 860,1
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)			300,0	300,0
Vencimiento de SC-Venta el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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
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
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	4 278,4	4 148,3	3 817,8	3 185,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0121%	0,0121%	0,0121%	0,0121%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	591,7	868,0	576,7	654,5
Tasa de interés	2,30%	2,30%	2,30%	2,30%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 686,7	3 280,3	3 241,1	2 536,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 225,7	11 255,7	11 059,2	10 922,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,1	12,2	11,9	11,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 999,0	5 785,7	5 670,0	5 530,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	6,3	6,1	6,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 103,5	967,5	1 200,5	1 133,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,55/3,51	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	381,2	369,2	325,9	324,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,50/0,50/0,50	0,40/0,50/0,40	0,30/0,35/0,35	0,30/0,30/0,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	46,5	56,5	40,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		41,5 / 3,45		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 Octubre 2014	20 Octubre 2014	21 Octubre 2014	22 Octubre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-65,8	27,0	-34,4	20,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-47,8	90,2	-42,4	250,7
a. Mercado spot con el público	-105,7	-71,6	-105,7	-144,8
i. Compras	228,4	234,7	217,6	232,7
ii. (-) Ventas	334,2	306,3	323,2	377,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	118,0	-198,0	12,3	-275,1
i. Pactadas	199,7	143,4	143,4	450,3
ii. (-) Vencidas	81,7	307,4	131,2	725,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	135,9	-134,8	4,3	-44,5
i. Pactadas	213,9	79,5	76,3	102,9
ii. (-) Vencidas	78,0	214,3	72,0	147,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	622,5	713,5	646,3	591,0
ii. A futuro	90,0	20,0	95,0	45,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	54,0	114,7	34,0	-159,9
i. Compras	77,7	212,2	71,5	147,3
ii. (-) Ventas	23,7	97,5	37,5	307,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,2	-46,0	-23,8	-22,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9019	2,9027	2,9004	2,9065
(*) Datos preliminares				