

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(en millones de Nuevos Soles)

	10 Noviembre 14	11 Noviembre 14	12 Noviembre 14	13 Noviembre 14	14 Noviembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 586,5	2 845,2	2 035,4	1 204,6	938,9
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	468,9		328,5	326,0	
Tasas de interés Mínima	185,4		547,4	384,4	
Máxima	2,98		3,30	3,38	
Promedio	3,31		3,36	3,39	
Saldo	3,28		3,36	3,39	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Diciembre de 2014	14 835,1	14 835,1	14 835,1	15 035,1	15 035,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 17 y el 21 de Noviembre de 2014			1 000,0	1 000,0	1 000,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	2 400,0	2 300,1	2 500,0	3 500,0	3 500,1
Plazo de vencimiento	2 965,0	2 919,0	3 625,0	6 750,0	6 292,0
Tasas de interés Mínima	1,4	1,4	1,4	1,4	3,6
Máxima	3,56	3,58	3,56	3,72	3,91
Promedio	3,62	3,61	3,65	3,81	4,01
Saldo	3,58	3,60	3,61	3,73	3,91
Próximo vencimiento de Repo el 17 de Noviembre de 2014	3 165,0	3 065,1	3 255,0	4 115,0	4 115,1
Vencimientos de REPO entre el 17 y el 21 de Noviembre de 2014			2 500,0	3 500,0	3 500,1
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas			290,0	290,0	
Plazo de vencimiento			63,4	63,4	
Tasas de interés Mínima			0,08	0,08	
Máxima			0,10	0,10	
Promedio			0,10	0,10	
Saldo	4 710,0	4 710,0	4 610,0	4 610,0	4 315,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 19 de Noviembre de 2014			295,0	295,0	500,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 17 y el 21 de Noviembre de 2014			295,0	295,0	790,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 291,5	4 291,5	4 291,5	4 291,5	4 291,5
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Diciembre de 2014			300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO entre el 17 y el 21 de Noviembre de 2014			0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300,0	600,0	599,9	600,0	194,0
Plazo de vencimiento	694,0	1 150,0	953,0	1 025,0	1 025,0
Tasas de interés Mínima	63,4	63,4	63,4	63,4	63,4
Máxima	0,04	0,01	0,01	0,00	0,01
Promedio	0,04	0,01	0,01	0,01	0,15
Saldo	0,04	0,01	0,01	0,01	0,04
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)	9 208,6	9 808,5	10 700,9	11 300,9	11 494,9
Vencimiento de SC-Venta entre el 17 y el 21 de Noviembre de 2014			300,0	300,0	300,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	-87,9	-351,8	-440,2	-14,7	0,0
ii. Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	30,0	120,0	150,0	5,0	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	2,923	2,932	2,934	2,936	
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	4 798,7	4 293,5	3 795,2	4 589,9	4 439,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0120%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,30%	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%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	499,4	512,0	500,2	510,9	499,5
Tasa de interés	2,30%	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	4 299,3	3 781,5	3 295,0	4 079,0	4 239,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 048,8	11 805,6	10 001,2	10 005,7	9 928,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,5	9,8	10,6	10,6	10,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 498,8	4 542,2	4 438,3	4 442,7	4 365,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,7	5,2	4,7	4,7	4,6
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	545,5	937,5	1 316,5	845,5	1 016,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50	3,50/3,85/3,55	3,50/3,80/3,57	3,50/4,01/3,79
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	7,0	11,5	0,0	6,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10		0,05/0,05/0,05
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	12,5	41,1	40,0	97,5	70,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					70,0 / 3,30
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	07 Noviembre	10 Noviembre	11 Noviembre	12 Noviembre	13 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	3,2	-252,1	228,4	175,7	-168,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	6,7	-158,2	124,0	13,2	101,2
a. Mercado spot con el público	-164,7	-80,8	-37,2	-135,8	1,4
i. Compras	235,1	270,9	202,4	211,0	301,5
ii. (-) Ventas	399,9	351,7	239,6	346,7	300,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-155,8	14,2	45,3	-229,3	-144,5
i. Pactadas	304,0	198,8	96,6	229,8	210,1
ii. (-) Vencidas	459,9	184,6	51,3	459,1	354,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-152,3	415,3	147,5	-87,8	329,7
i. Pactadas	204,3	589,7	217,0	477,2	668,3
ii. (-) Vencidas	356,6	174,4	69,5	564,9	339,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	879,0	896,1	486,2	347,2	561,0
ii. A futuro	52,0	115,0	170,0	45,0	110,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	36,4	151,0	63,9	151,5	86,7
i. Compras	320,2	172,6	68,9	561,2	337,8
ii. (-) Ventas	283,8	21,6	5,0	409,6	251,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	31,8	68,7	320,1	407,3	202,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9281	2,9294	2,9316	2,9352	2,9344
(*) Datos preliminares					