

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	9 Junio 14	10 Junio 14	11 Junio 14	12 Junio 14	13 Junio 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7,845.0	7,772.0	7,338.6	7,601.0	6,908.5
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	100.0
Plazo de vencimiento	436.5		410.0	639.2	572.0
Tasas de interés	185 d		547 d	364 d	31 d
Mínima	3.80		3.85	3.79	3.70
Máxima	3.85		3.89	3.83	3.84
Promedio	3.84		3.87	3.81	3.79
Saldo	14,795.0	14,795.0	14,895.0	14,845.1	14,945.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Julio de 2014				2,350.1	2,350.1
Vencimientos de CD BCRP entre el 16 y el 20 de Junio de 2014				0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Próximo vencimiento de Repo el 7 de Agosto de 2014.					
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Junio de 2014				0.0	0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	710.0	710.0	710.0	710.0	710.0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 30 de Junio de 2014				0.0	0.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 16 y el 20 de Junio de 2014				0.0	0.0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					300.0
Plazo de vencimiento					618.0
Tasas de interés					731 d
Mínima					4.00
Máxima					4.65
Promedio					4.37
Saldo	1,900.0	1,900.0	1,900.0	1,900.0	2,200.0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)				100.0	100.0
Vencimientos de REPO entre el 16 y el 20 de Junio de 2014				0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	-100.0	0.0	-440.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		100.0		440.0	
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	7,745.0	7,772.0	7,238.6	7,200.9	7,108.5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0126%	0.0126%	0.0126%	0.0126%	0.0126%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	381.9	486.6	647.5	446.4	360.6
	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	7,363.1	7,285.4	6,591.1	6,754.5	6,747.9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12,219.2	12,145.7	12,267.1	12,306.2	12,267.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13.2	13.1	13.2	13.2	13.2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6,842.9	7,050.2	7,074.2	7,047.6	7,008.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.5	7.4	7.5	7.6	7.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,409.0	1,241.0	1,351.5	1,238.5	1,141.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,004,05/4,00	4,004,00/4,00	3,903,95/3,95	3,95/3,95/3,95	3,95/4,00/3,96
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	138.0	105.0	104.0	25.0	40.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,05/0,10/0,08	0,10/0,10/0,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	29.0	5.0	4.7	57.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					56,0 / 3,80
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	06 Junio 2014	09 Junio 2014	10 Junio 2014	11 Junio 2014	12 Junio 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	83.7	26.4	-11.1	199.0	-41.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	144.2	60.0	93.3	238.6	-168.1
a. Mercado spot con el público	63.9	-14.0	-54.1	194.5	-247.6
i. Compras	263.5	230.8	308.5	391.3	291.7
ii. (-) Ventas	199.6	244.7	362.6	196.8	539.3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	3.1	83.7	-225.5	-86.7	-39.1
i. Pactadas	283.8	179.0	298.9	95.5	269.1
ii. (-) Vencidas	280.7	95.3	524.4	182.2	308.2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	63.5	117.3	-121.1	-47.1	-165.4
i. Pactadas	212.9	248.4	304.7	103.5	108.8
ii. (-) Vencidas	149.4	131.1	425.8	150.5	274.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	632.0	709.3	1017.6	851.8	647.5
ii. A futuro	5.0	184.0	56.0	83.0	50.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-50.6	109.8	45.6	12.9	59.1
i. Compras	148.7	127.1	421.3	150.3	273.6
ii. (-) Ventas	199.2	17.3	375.8	137.4	214.6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
g. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera	-0.5	0.0	3.3	-0.4	-13.6
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7832	2.7871	2.7894	2.7976	2.7956
(*) Datos preliminares					