

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	30 Junio 14	1 Julio 14	2 Julio 14	3 Julio 14	4 Julio 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 867,9	5 944,1	6 784,6	6 915,5	7 148,6
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	378,0		228,8	346,0	
Tasas de interés Mínima	192 d		554 d	371 d	
Máxima	3,70		3,48	3,84	
Promedio	3,72		4,07	4,00	
Saldo	16 345,2		16 445,2	16 545,2	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Julio de 2014		2 350,1		2 350,1	
Vencimientos de CD BCRP entre el 7 y el 11 de Julio de 2014		0,0		0,0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas		1 000,0 500,0	1 000,0 1 000,0	1 000,0 200,0 1 000,0	1 000,0 200,0 800,0
Plazo de vencimiento		2 000,0 1 750,0	2 002,5 2 650,0	2 500,0 239,0 2 250,0	2 610,0 239,0 1 300,0
Tasas de interés Mínima		7 d 1 d	1 d 1 d	1 d 98 d 1 d	3 d 97 d 3 d
Máxima		4,20 4,21	4,11 4,12	4,13 4,35 4,11	4,12 4,36 4,16
Promedio		4,20 4,21	4,20 4,15	4,16 4,35 4,16	4,15 4,36 4,17
Saldo	100,0	4,20 4,21	4,13 4,14	4,15 4,35 4,15	4,13 4,36 4,17
Próximo vencimiento de Repo el 7 de Julio de 2014.		1 600,0	3 100,0	3 300,0	3 300,0
Vencimientos de REPO entre el 7 y el 11 de Julio de 2014		500,0		2 000,0	1 800,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas		700,0	700,0	700,0	700,0
Plazo de vencimiento		200,0	200,0	200,0	200,0
Tasas de interés Mínima		0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima		0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio		0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	700,0	700,0	700,0	700,0	700,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 7 de Julio de 2014		200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 7 y el 11 de Julio de 2014		0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas		2 500,0	2 500,0	2 700,0	2 900,0
Plazo de vencimiento		100,0	100,0	100,0	100,0
Tasas de interés Mínima		0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima		0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio		0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	2 500,0	2 500,0	2 500,0	2 700,0	2 900,0
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)		100,0	100,0	100,0	100,0
Vencimientos de REPO entre el 7 y el 11 de Julio de 2014		0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	5 767,9	7 444,1	8 684,6	9 215,5	9 348,6
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%	0,0127%
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 regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2 403,5	1,1	1,1	0,0	191,2
Tasa de interés	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	3 364,4	7 444,1	8 683,5	9 215,5	9 157,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 391,6	12 693,9	13 313,5	13 100,3	13 403,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,2	19,4	16,8	13,9	14,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 300,8	7 444,1	7 442,8	8 033,7	8 336,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	11,4	10,2	8,5	8,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 225,0	964,0	680,0	844,8	435,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,90/4,00/3,99	4,00/4,25/4,09	4,00/4,13/4,10	4,10/4,20/4,13	4,15/4,15/4,15
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	8,0	56,0	46,0	174,0	190,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,10/0,10	0,10/0,12/0,10	0,10/0,20/0,12	0,10/0,15/0,14	0,10/0,20/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	77,3	90,5	0,0	10,0	20,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	46,4 / 3,70				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Junio 2014	30 Junio 2014	01 Julio 2014	02 Julio 2014	03 Julio 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	128,4	67,7	-67,5	193,4	-10,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	195,9	13,2	-128,7	-37,8	-120,4
a. Mercado spot con el público	53,8	-102,6	-158,8	-77,2	-146,8
i. Compras	406,6	305,4	222,9	222,9	311,6
ii. (-) Ventas	352,8	408,0	384,8	300,0	458,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-5,3	-136,7	62,8	86,1	243,2
i. Pactadas	158,1	225,1	176,8	167,8	309,7
ii. (-) Vencidas	163,4	361,8	109,0	81,7	66,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	62,2	-191,1	6,6	-145,1	133,2
i. Pactadas	128,9	193,7	97,8	195,9	233,6
ii. (-) Vencidas	66,7	384,8	91,3	341,0	100,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1322,4	1088,3	780,3	1137,3	1233,1
ii. A futuro	80,0	148,0	42,0	90,0	205,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	54,5	143,4	13,9	301,1	77,9
i. Compras	58,1	378,8	84,1	341,0	86,4
ii. (-) Ventas	3,6	235,5	70,2	39,9	8,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-9,1	-4,6	-1,5	-2,4	-17,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7991	2,7949	2,7962	2,7946	2,7830
(*) Datos preliminares					