

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	7 Julio 14	8 Julio 14	9 Julio 14	10 Julio 14	11 Julio 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 844,6	6 796,7	6 444,7	8 180,0	8 154,6
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	300,0
Plazo de vencimiento	526,7		506,5	752,0	1 406,0
Tasas de interés Mínima	185 d		547 d	364 d	181 d
Máxima	3,70		3,85	3,72	3,45
Promedio	3,70		3,97	3,72	3,60
Saldo	3,70		3,92	3,72	3,55
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Julio de 2014	16 645,2	16 645,2	16 745,2	14 495,1	14 795,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 14 y el 18 de Julio de 2014		2 350,1		600,1	600,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500,0	500,0	500,0		
Plazo de vencimiento	1 000,0	500,0	1 000,0		
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d		
Máxima	4,12	4,12	4,08		
Promedio	4,15	4,13	4,10		
Saldo	4,14	4,13	4,09		
Próximo vencimiento de Repo el 7 de Agosto de 2014.	2 000,0	1 000,0	1 000,0	500,0	500,0
Vencimientos de REPO entre el 14 y el 18 de Julio de 2014		500,0		100,0	100,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 15 de Julio de 2014	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 14 y el 18 de Julio de 2014		100,0		100,0	100,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo (7 de Agosto de 2014)	2 900,0	2 900,0	2 900,0	2 900,0	2 900,0
Vencimientos de REPO entre el 14 y el 18 de Julio de 2014		100,0		100,0	100,0
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	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	8 244,6	7 296,7	6 844,7	7 980,0	7 154,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	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 regulación 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	187,5	193,6	201,4	21,2	20,0
	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	8 057,1	7 103,1	6 643,3	7 058,8	7 134,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 660,9	13 500,9	13 534,1	13 419,2	13 252,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,5	14,3	14,3	14,2	14,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 624,5	8 434,3	8 496,4	8 352,7	8 185,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,1	9,0	9,0	8,8	8,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 153,0	1 410,5	1 576,0	1 388,0	1 492,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,05/4,15/4,09	4,05/4,10/4,07	4,05/4,10/4,05	4,05/4,10/4,05	3,75/3,80/3,76
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	188,0	182,0	187,0	182,0	250,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	98,0 / 3,70	30,0	17,0	0,0	101,0
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\$)	04 Julio 2014	07 Julio 2014	08 Julio 2014	09 Julio 2014	10 Julio 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	96,5	-184,4	15,5	31,3	54,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	140,0	-27,3	53,5	171,7	52,1
a. Mercado spot con el público	99,7	-0,9	38,8	177,4	31,8
i. Compras	320,1	290,5	382,0	368,0	421,7
ii. (-) Ventas	220,3	291,4	343,2	190,7	389,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	6,3	-172,9	-39,4	-35,8	86,3
i. Pactadas	45,7	152,9	167,1	116,2	160,5
ii. (-) Vencidas	39,4	325,7	206,5	151,9	74,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	46,8	-15,8	-1,5	104,6	83,9
i. Pactadas	61,6	155,1	126,8	200,3	330,6
ii. (-) Vencidas	14,8	170,9	128,3	95,7	246,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	614,0	880,3	971,7	369,0	1182,2
ii. A futuro	20,0	203,0	147,0	92,0	125,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	11,7	-105,1	-67,7	-46,9	188,0
i. Compras	12,4	153,6	128,1	95,6	241,2
ii. (-) Ventas	0,7	258,6	195,8	142,5	43,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,0	-76,3	4,1	-15,0	-5,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7757	2,7734	2,7837	2,7830	2,7798
(*) Datos preliminares					