

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	25 Agosto 14	26 Agosto 14	27 Agosto 14	28 Agosto 14	29 Agosto 14
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>5 192,5</b>	<b>4 472,1</b>	<b>4 090,4</b>	<b>3 025,7</b>	<b>2 639,2</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)</u>					
Propuestas recibidas	100,0		100,0	100,0	
Plazo de vencimiento	398,0		238,0	203,0	
Tasas de interés Mínima	171 d		533 d	350 d	
Máxima	3,49		3,64	3,65	
Promedio	3,65		3,89	3,65	
Saldo	3,51		3,69	3,65	
Próximo vencimiento de Repo el 11 de Setiembre de 2014	16 884,8	16 884,8	16 984,8	17 084,8	17 084,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 1 y el 5 de Setiembre de 2014			820,0	820,0	820,0
			0,0	0,0	0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</u>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	650,0	650,0	650,0	650,0	650,0
Próximo vencimiento de Repo el 9 de Octubre de 2014			400,0	400,0	400,0
Vencimientos de REPO entre el 1 y el 5 de Setiembre de 2014			0,0	0,0	0,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)</u>					
Propuestas recibidas			300,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento			450,0	970,0	430,0
Tasas de interés Mínima			61 d	61 d	61 d
Máxima			0,04	0,03	0,04
Promedio			0,15	0,05	0,15
Saldo	130,0	130,0	0,07	0,04	0,09
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 20 de octubre de 2014			730,0	1 030,0	1 330,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 1 y el 5 de Setiembre de 2014			130,0	130,0	130,0
			0,0	0,0	0,0
iv. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 200,0	3 200,0	3 200,0	3 200,0	3 200,0
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)			400,0	400,0	400,0
Vencimiento de REPO entre el 1 y el 5 de Setiembre de 2014			0,0	0,0	0,0
			0,0	0,0	0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>					
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. <u>Compras de BTP</u>					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4 092,5</b>	<b>3 872,1</b>	<b>3 390,4</b>	<b>2 625,7</b>	<b>2 339,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0124%	0,0124%	0,0124%	0,0124%	0,0124%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%	4,55%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	1 186,3	218,3	652,2	225,9	319,7
	2,55%	2,55%	2,55%	2,55%	2,55%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>2 906,2</b>	<b>3 653,8</b>	<b>2 738,2</b>	<b>2 399,8</b>	<b>2 299,5</b>
a. <u>Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</u>	11 624,2	11 747,1	11 416,1	11 322,7	11 211,4
b. <u>Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</u>	12,4	12,5	12,2	12,1	11,9
c. <u>Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</u>	6 264,6	5 960,9	5 841,5	5 748,1	5 636,9
d. <u>Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</u>	6,4	6,6	6,2	6,1	6,0
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	971,5	718,0	1 395,0	1 270,0	1 410,1
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,70/3,75/3,74	3,70/3,75/3,74	3,70/3,75/3,75	3,70/3,80/3,75	3,75/3,80/3,76
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	61,9	45,2	43,0	46,5	28,6
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	0,12/0,12/0,12	0,12/0,12/0,12	0,12/0,15/0,13	0,12/0,15/0,13	0,12/0,15/0,15
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	20,0	0,0	30,0	1,3	101,5
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>22 Agosto 2014</b>	<b>25 Agosto 2014</b>	<b>26 Agosto 2014</b>	<b>27 Agosto 2014</b>	<b>28 Agosto 2014</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	29,9	15,6	-172,1	-34,8	91,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	5,0	-11,2	-107,8	-53,0	51,0
a. <u> Mercado spot con el público</u>	-90,6	-116,8	-292,8	-433,5	-127,2
i. <u> Compras</u>	251,8	280,9	283,2	214,5	339,4
ii. <u> (-) Ventas</u>	342,5	397,6	576,0	648,1	466,6
b. <u> Compras forward al público (con v sin entrega)</u>	112,0	71,6	143,8	169,9	33,2
i. <u> Pactadas</u>	251,1	193,3	358,9	414,5	185,0
ii. <u> (-) Vencidas</u>	149,0	121,6	215,1	244,6	151,8
c. <u> Ventas forward al público (con v sin entrega)</u>	87,2	44,9	208,1	151,7	-7,3
i. <u> Pactadas</u>	179,0	113,3	313,6	334,9	213,6
ii. <u> (-) Vencidas</u>	91,8	68,5	105,5	183,2	220,9
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u> Al contado</u>	1476,2	1077,0	1126,7	921,3	1183,0
ii. <u> A futuro</u>	136,0	40,0	30,0	353,2	105,0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	34,7	52,4	85,5	115,4	138,3
i. <u> Compras</u>	90,5	66,7	104,6	182,4	199,1
ii. <u> (-) Ventas</u>	55,8	14,3	19,2	66,9	60,8
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	3,7	0,0	-10,2	203,8	109,0
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8283	2,8340	2,8331	2,8408	2,8452
(*) Datos preliminares					