

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	29 Setiembre 14	30 Setiembre 14	1 Octubre 14	2 Octubre 14	3 Octubre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	202,3	199,0	1 887,6	2 884,3	4 332,0
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)	100,0		100,0	100,0	
Propuestas recibidas	349,6		111,0	166,0	
Plazo de vencimiento	164 d		554 d	378 d	
Tasas de interés Mínima	3,42		3,65	3,50	
Máxima	3,52		3,65	3,86	
Promedio	3,48		3,65	3,73	
Saldo	17 564,8	17 564,8	17 664,8	17 754,8	17 764,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Octubre de 2014		2 199,8		2 199,8	2 199,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 6 y el 10 de Octubre de 2014		0,0		0,0	2 199,8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 000,0 2 900,0	300,0 1 000,0 1 850,0	1 000,0 2 500,0 1 000,0 15,0	2 000,0 1 000,0 2 000,0	2 000,0 1 500,0
Propuestas recibidas	1 110,0 3 197,0	300,0 1 170,0 1 850,0	3 305,0 3 815,0 1 840,0 335,0	4 105,0 1 680,0 2 146,0	3 550,0 2 270,0
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	91 d 7 d 1 d	1 d 1 d 8 d 90 d	1 d 7 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés Mínima	3,81 4,12	3,50 3,75 4,13	4,14 3,99 3,79 3,52	3,81 3,81 3,51	3,54 3,52
Máxima	3,83 4,15	3,50 4,00 4,46	4,16 4,17 3,96 3,52	4,06 3,81 4,18	3,91 3,98
Promedio	3,81 4,13	3,50 3,82 4,15	4,15 4,01 3,81 3,52	3,85 3,81 3,73	3,60 3,58
Saldo	4 850,0	5 100,0	7 765,0	9 265,0	8 765,0
Próximo vencimiento de Repo el 6 de Octubre de 2014		1 850,0		4 000,0	4 500,0
Vencimientos de REPO entre el 6 y el 10 de Octubre de 2014		1 850,0		4 000,0	7 900,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	100,0 100,0 120,0	130,0	170,0	150,0	140,0
Propuestas recibidas	100,0 100,0 120,0	130,0	170,0	150,0	140,0
Plazo de vencimiento	63 d 63 d 63 d	63 d	63 d	63 d	63 d
Tasas de interés Mínima	0,13 0,14 0,15	0,15	0,10	0,14	0,15
Máxima	0,15 0,15 0,15	0,15	0,15	0,15	0,15
Promedio	0,14 0,14 0,15	0,15	0,14	0,15	0,15
Saldo	5 625,0	5 955,0	6 125,0	6 230,0	6 420,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 20 de Octubre de 2014		130,0		130,0	130,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 6 y el 10 de Octubre de 2014		0,0		0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera	0,0	300,0	91,5	400,0	400,0
Propuestas recibidas		537,0	141,5	400,0	400,0
Plazo de vencimiento		91 d	90 d		
Tasas de interés Mínima		3,80	3,55		
Máxima		4,10	3,83		
Promedio		3,92	3,65		
Saldo	4 400,0	4 700,0	4 791,5	4 791,5	4 791,5
Próximo vencimiento de Repo (9 de Octubre de 2014)		400,0		400,0	400,0
Vencimiento de REPO entre el 6 y el 10 de Octubre de 2014		0,0		0,0	0,0
vi. Subasta de Swap Cambiario venta del BCRP					
Propuestas recibidas					300,0
Plazo de vencimiento					570,0
Tasas de interés Mínima					63 d
Máxima					0,00
Promedio					0,15
Saldo				0,0	300,0
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)					300,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 6 y el 10 de Octubre de 2014					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-173,8	0,0	0,0	0,0	-116,1
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					40,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2 891,0				2 901,6
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 508,5	3 519,0	6 224,1	7 629,3	7 576,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0121%	0,0122%	0,0122%	0,0121%	0,0121%
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	515,9	1 720,6	0,0	0,0	410,0
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	2 992,6	1 799,4	6 224,1	7 629,3	7 166,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 579,3	10 611,7	11 802,4	11 803,7	11 927,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,3	11,3	13,2	12,2	12,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 144,9	5 033,3	4 821,3	6 225,3	6 538,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,4	7,0	6,5	7,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	607,0	582,0	303,0	204,0	195,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,904/1,54/0,2	4,004/0,04/0,00	4,004/20/4,14	3,904/0,05/3,95	3,55/3,80/3,62
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	86,5	55,6	113,8	218,5	219,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,20/0,16	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,15	0,15/0,20/0,16	0,15/0,25/0,17
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	90,0	133,0	80,0	143,0	35,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		50,0 / 3,62			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 Setiembre 2014	29 Setiembre 2014	30 Setiembre 2014	01 Octubre 2014	2 Octubre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	125,2	122,3	90,2	-178,9	39,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-26,3	2,4	123,7	-166,1	-35,9
a. Mercado spot con el público	-598,5	-396,0	-110,5	-400,2	-183,0
i. Compras	320,5	299,4	465,9	312,4	266,3
(-) Ventas	919,0	695,4	576,4	712,7	449,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	249,0	210,4	-23,0	125,4	-3,1
i. Pactadas	489,0	453,5	427,2	387,0	221,5
(-) Vencidas	239,9	243,2	450,3	261,6	224,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	97,5	90,5	10,4	136,1	-78,2
i. Pactadas	437,9	154,1	432,4	253,0	423,6
(-) Vencidas	340,4	63,6	421,9	114,9	501,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	479,2	322,7	741,2	452,8	310,5
ii. A futuro	90,0	170,0	280,0	90,0	100,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	213,5	51,3	166,1	35,3	367,7
i. Compras	330,1	56,2	412,0	111,3	501,3
ii. (-) Ventas	116,6	4,9	245,9	75,9	133,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	459,1	167,5	39,7	52,1	56,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8959	2,8951	2,8906	2,8917	2,8971
(*) Datos preliminares					