

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	13 Octubre 14	14 Octubre 14	15 Octubre 15	16 Octubre 14	17 Octubre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 099,7	3 805,6	3 453,2	3 346,4	3 197,5
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 BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	100,0		100,0	100,0	
Plazo de vencimiento	516,5		409,6	376,6	
Tasas de interés Mínima	1,6		540,4	364,4	
Máxima	3,50		3,51	3,43	
Promedio	3,51		3,51	3,48	
Saldo	15 865,0	15 865,0	15 965,0	16 065,0	15 834,9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Noviembre de 2014			230,1	1 999,9	1 999,9
Vencimientos de CD BCRP entre el 20 y el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 000,0 1 830,0	1 000,0 800,0	1 800,0	1 500,0	2 400,0
Propuestas recibidas	1 010,0 1 830,0	1 560,0 1 050,0	2 010,0	2 089,0	2 815,0
Plazo de vencimiento	7,4 1,4	1,4 1,4	1,4	1,4	3,4
Tasas de interés Mínima	3,60 3,61	3,51 3,61	3,53	3,55	3,66
Máxima	3,60 3,55	3,51 3,55	3,53	3,60	3,64
Promedio	3,60 3,52	3,51 3,51	3,53	3,57	3,59
Saldo	3 695,0	3 665,0	3 665,0	3 365,0	4 265,0
Próximo vencimiento de Repo el 20 de Octubre de 2014			1 800,0	1 500,0	2 400,0
Vencimientos de REPO entre el 20 y el 24 de Octubre de 2014			1 800,0	1 500,0	3 400,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 420,0	6 420,0	6 420,0	6 420,0	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 20 y el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0	130,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 391,5	4 391,5	4 391,5	4 391,5	4 391,5
Próximo vencimiento de Repo (3 de Noviembre de 2014)			100,0	100,0	100,0
Vencimiento de REPO entre el 20 y el 24 de Octubre de 2014			0,0	0,0	0,0
vii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			300,0 230,1	300,0	0,0
Propuestas recibidas			644,6 230,1	627,3	
Plazo de vencimiento			61,4 61,4	61,4	
Tasas de interés Mínima			0,09 0,10	0,12	
Máxima			0,12 0,14	0,17	
Promedio			0,11 0,12	0,15	
Saldo	1 800,0	1 800,0	2 330,1	2 630,1	2 630,1
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)			300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 20 y el 24 de Octubre de 2014			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	-29,1	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)			10,0		
Tipo de cambio promedio			2,9076		
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	5 829,7	5 605,6	5 124,1	4 746,4	5 597,5
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%	0,0121%	0,0121%	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	456,6	589,3	664,3	467,3	575,2
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	5 373,1	5 016,3	4 459,8	4 279,1	5 022,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 842,2	11 865,5	11 660,2	11 564,3	11 499,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,8	12,8	12,6	12,5	12,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 588,6	6 400,4	6 271,0	6 175,1	6 110,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	7,0	6,8	6,7	6,6
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	521,5	935,5	683,0	1 102,0	1 303,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	3,50/3,60/3,59	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50	3,50/3,60/3,52	3,50/3,55/3,52
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	196,5	257,8	270,7	203,5	213,8
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,500/0,500/0,50	0,500/0,500/0,50	0,500/0,500/0,50	0,500/0,500/0,50	0,500/0,500/0,50
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0	88,6	0,0	25,0	18,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		81,1 / 3,50			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 Octubre 2014	13 Octubre 2014	14 Octubre 2014	15 Octubre 2014	16 Octubre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-181,0	-44,5	72,5	175,2	-57,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-142,6	3,5	-32,2	92,3	-67,8
a. Mercado spot con el público	-288,1	-67,2	-185,0	-0,1	-121,4
i. Compras	334,3	212,6	282,5	324,4	213,1
ii. (-) Ventas	622,4	279,9	467,5	324,5	334,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-88,7	-38,0	1,8	-29,9	-167,9
i. Pactadas	341,6	53,3	375,2	94,2	65,7
ii. (-) Vencidas	430,3	91,2	373,3	124,2	263,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	53,0	10,0	-102,9	69,5	-74,7
i. Pactadas	135,4	20,2	86,6	273,2	264,6
ii. (-) Vencidas	82,4	10,2	189,4	203,9	339,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	813,3	498,2	677,0	461,3	961,0
ii. A futuro	160,0	55,0	101,0	95,0	60,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-201,7	-2,8	-26,2	161,5	138,6
i. Compras	73,5	7,4	186,4	201,9	339,1
ii. (-) Ventas	275,2	10,2	212,6	40,4	200,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	102,6	-7,5	-4,9	192,7	93,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9052	2,9033	2,9040	2,9078	
(*) Datos preliminares					