

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	27 Octubre 14	28 Octubre 14	29 Octubre 14	30 Octubre 14	31 Octubre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 657,5	2 813,4	3 187,3	3 375,0	3 565,0
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)					
Propuestas recibidas	100,0		100,0	100,0	
Plazo de vencimiento	506,0		307,1	427,0	
Tasas de interés Mínima	164 d		529 d	350 d	
Máxima	3,34		3,31	3,25	
Promedio	3,38		3,31	3,33	
Saldo	3,26		3,31	3,31	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Noviembre de 2014	16 235,0	16 235,0	16 335,0	16 435,0	16 435,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 3 y el 7 de Noviembre de 2014			1 999,9	1 999,9	1 999,9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500,0				
Plazo de vencimiento	500,0				
Tasas de interés Mínima	1 d				
Máxima	3,50				
Promedio	3,50				
Saldo	1 365,0	865,0	865,0	865,0	865,0
Próximo vencimiento de Repo el 3 de Noviembre de 2014			100,0	100,0	100,0
Vencimientos de Repo entre el 3 y el 7 de Noviembre de 2014			0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	205,0				
Plazo de vencimiento	235,0				
Tasas de interés Mínima	63 d				
Máxima	0,06				
Promedio	0,17				
Saldo	0,10				
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 3 de Noviembre de 2014	5 895,0	5 895,0	5 895,0	5 895,0	5 895,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 3 y el 7 de Noviembre de 2014			300,0	300,0	600,0
vii. 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 IIE entre el 3 y el 7 de Noviembre de 2014			0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	300,0	600,0	300,0	300,0	300,0
Plazo de vencimiento	727,5	812,6	1 014,8	426,8	537,7
Tasas de interés Mínima	63 d	63 d	63 d	64 d	66 d
Máxima	0,06	0,01	0,01	0,01	0,01
Promedio	0,07	0,05	0,07	0,08	0,01
Saldo	0,06	0,04	0,04	0,05	0,01
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)	4 360,2	5 185,2	5 485,2	5 785,2	6 935,2
Vencimiento de SC-Venta entre el 3 y el 7 de Noviembre de 2014			300,0	300,0	300,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
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	2 852,5	2 813,4	3 087,3	3 216,6	2 828,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0121%	0,0121%	0,0121%	0,0120%	0,0120%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
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	692,6	992,4	1 287,1	1 665,4	752,8
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	2 159,9	1 821,0	1 800,2	1 551,2	2 075,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 436,2	10 547,6	10 199,0	10 087,5	10 007,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,3	11,4	11,0	10,9	10,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 278,3	4 913,6	4 806,2	4 694,7	4 614,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,4	5,6	5,2	5,1	5,0
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 539,0	2 040,0	1 649,0	978,0	1 086,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50	3,50/3,55/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	215,7	194,5	140,0	34,2	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	2,5	6,8	96,0	24,0	0,0
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\$)	24 Octubre 2014	27 Octubre 2014	28 Octubre 2014	29 Octubre 2014	30 Octubre 2014
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	80,2	-61,7	-73,6	-3,7	-0,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	70,5	-153,4	-173,2	49,9	19,2
a. Mercado spot con el público	-150,9	-183,3	-139,3	-35,1	-23,0
i. Compras	193,0	215,7	171,9	292,3	305,0
ii. (-) Ventas	343,9	399,0	311,3	327,4	328,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-14,4	-245,0	48,1	-76,0	265,3
i. Pactadas	142,3	164,0	145,6	83,9	592,4
ii. (-) Vencidas	156,8	409,0	97,6	159,9	327,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	182,1	-28,0	231,5	80,5	387,6
i. Pactadas	242,4	304,8	243,5	300,5	659,3
ii. (-) Vencidas	60,2	332,7	12,0	220,0	271,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	761,0	983,3	1141,2	1120,2	1297,2
ii. A futuro	85,0	135,0	136,5	150,0	75,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	29,8	109,4	6,1	146,8	17,1
i. Compras	57,8	331,0	11,1	214,9	263,3
ii. (-) Ventas	27,9	221,6	5,0	68,0	246,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	301,3	152,9	157,5	101,2	72,4
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9100	2,9154	2,9159	2,9145	2,9177
(*) Datos preliminares					