

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	17 Noviembre 14	18 Noviembre 14	19 Noviembre 14	20 Noviembre 14	21 Noviembre 14
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	619,2	1 610,5	2 771,7	2 743,7	2 551,0
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	181,0		223,0	121,0	
Tasas de interés Mínima	178,4		540,4	357,4	
Máxima	3,30		3,36	3,39	
Promedio	3,50		3,50	3,75	
Saldo	3,40		3,49	3,65	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 11 de Diciembre de 2014	15 135,1	15 135,1	15 235,1	15 335,1	15 335,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 24 y el 28 de Noviembre de 2014			1 000,0	1 000,0	1 000,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1 000 4 500	3 000 1 000 1 000 575	3 000 705	2 500 1 000	2 000,0 1 500,0
Plazo de vencimiento	2 000 5 285	4 860 1 220 1 665 575	4 015 705	3 285 1 753	3 077,0 1 660,0
Tasas de interés Mínima	7,6 1,4	1,6 7,6 1,6 1,4	1,4 1,4	1,3 1,4	3,4 3,4
Máxima	4,50 4,51	4,33 4,05 4,45 3,55	3,57 3,50	3,54 3,50	3,67 3,53
Promedio	4,88 5,00	4,61 4,05 4,45 4,45	3,95 3,72	3,69 3,81	3,68 3,72
Saldo	4,69 4,78	4,49 4,05 4,45 4,29	3,63 3,62	3,58 3,65	3,67 3,59
Próximo vencimiento de Repo el 24 de Noviembre de 2014	6 115,0	7 190,0	6 320,0	6 115,0	6 115,0
Vencimientos de REPO entre el 24 y el 28 de Noviembre de 2014			3 705,0	3 500,0	4 500,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 315,0	4 315,0	4 315,0	3 815,0	3 525,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 24 de Noviembre de 2014			290,0	290,0	300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 24 y el 28 de Noviembre de 2014			290,0	290,0	1 145,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 291,5	4 291,5	4 591,5	4 591,5	4 591,5
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Diciembre de 2014			300,0	300,0	300,0
Vencimiento de REPO entre el 24 y el 28 de Noviembre de 2014			0,0	0,0	0,0
viii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 494,9	11 494,9	11 494,9	11 494,9	11 759,9
Próximo vencimiento de SC-Venta (5 de Diciembre de 2014)			300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC-Venta entre el 24 y el 28 de Noviembre de 2014			0,0	0,0	0,0
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	6 019,2	7 185,5	6 676,7	6 143,7	6 051,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0120%	0,0120%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	169,0				
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	507,4	506,1	517,4	520,3	519,8
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	5 680,8	6 679,4	6 159,3	5 623,4	5 531,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 998,7	10 036,7	10 065,4	10 234,9	10 228,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,6	10,6	10,6	10,8	10,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 344,1	4 410,4	4 502,4	4 571,9	4 665,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,7	4,7	4,8	4,9	4,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	632,5	382,5	631,0	607,5	913,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	3,805,05/4,22	4,404,60/4,45	3,704,00/3,76	3,553,70/3,57	3,603,65/3,62
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	31,0	4,2	0,0	10,0	10,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,05/0,15/0,12	0,05/0,05/0,05		0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	6,4 / 3,30	25,0	15,0	0,0	7,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	14 Noviembre	17 Noviembre	18 Noviembre	19 Noviembre	20 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-113,7	21,8	132,7	-105,5	-108,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	1,8	-87,6	6,4	-226,9	-64,9
a. Mercado spot con el público	32,9	-257,9	-95,7	-116,3	-168,3
i. Compras	242,2	218,6	241,0	209,4	212,2
ii. (-) Ventas	309,3	476,5	336,7	325,8	380,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	156,8	-24,5	73,6	61,1	88,6
i. Pactadas	284,3	233,1	246,0	153,2	373,9
ii. (-) Vencidas	127,5	257,6	172,4	92,1	285,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	338,5	-133,9	-52,8	-60,3	132,0
i. Pactadas	393,0	155,4	65,7	156,0	418,0
ii. (-) Vencidas	54,5	289,3	118,8	216,3	286,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	361,4	380,0	307,0	763,4	775,0
ii. A futuro	75,0	80,0	18,0	90,0	35,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	7,7	209,3	47,8	190,9	114,1
i. Compras	49,5	282,6	118,0	211,0	284,8
ii. (-) Ventas	41,9	73,4	70,2	20,1	170,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-45,6	-7,3	0,3	-177,3	-10,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,9344	2,9314	2,9281	2,9284	2,9229
(*) Datos preliminares					