

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	09 Diciembre	10 Diciembre	11 Diciembre	12 Diciembre	13 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 935,2	7 591,7	7 753,5	8 587,5	6 944,6
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 BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50,0		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	204,8		232,0	314,8	
Tasas de interés: Mínima	185 d		547 d	364 d	
Máxima	3,57		3,43	3,55	
Promedio	3,62		3,68	3,61	
	3,61		3,66	3,60	
Saldo	20 213,4	20 213,4	20 263,4	18 692,4	18 692,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Enero de 2014		1 621,0	1 621,0		2 250,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 16 y el 20 de Diciembre de 2013		1 621,0	1 621,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	3 000,0	3 000,0	2 000,0	2 000,0	3 000,0
Plazo de vencimiento	320,0	1 860,0	2 225,0	3 117,0	1 449,0
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,45	4,26	4,45	4,10	4,16
Promedio	4,63	4,72	4,60	4,15	4,18
Saldo	4,51	4,60	4,50	4,12	4,17
Próximo vencimiento de Repo el 16 de Diciembre de 2013	5 320,0	6 320,0	1 320,0	5 320,0	4 769,0
Vencimientos de Repo entre el 16 y el 20 de Diciembre de 2013		5 000,0	1 320,0		4 769,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	0,0	130,0			
Plazo de vencimiento	64 d	63 d			
Tasas de interés: Mínima		0,13			
Máxima		0,14			
Promedio		0,14			
Saldo	2 846,0	2 976,0	2 976,0	2 976,0	2 976,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 23 de Diciembre de 2013		10,0			10,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 16 y el 20 de Diciembre de 2013		0,0			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	12 205,2	12 461,7	12 203,5	12 537,5	11 393,6
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)	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0127%
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	358,5	358,0	356,9	394,5	392,9
	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	11 846,7	12 103,7	11 846,6	12 143,0	11 000,7
a. Fondos de encate en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 505,0	16 401,3	16 680,4	16 680,4	16 614,8
b. Fondos de encate en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,9	17,8	18,1	18,1	18,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 649,0	11 694,5	11 973,5	11 983,5	11 907,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,8	12,7	13,0	13,0	12,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	561,2	402,0	823,0	823,0	1 071,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,60/4,50	4,00/4,50/4,29	4,05/4,20/4,14	4,05/4,20/4,14	4,10/4,25/4,12
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	16,0	111,3	182,0	182,0	51,4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		14,2 / 3,60	30,0 / 3,60	30,0 / 3,60	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	06 Diciembre	09 Diciembre	10 Diciembre	11 Diciembre	12 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	8,6	-97,4	131,0	87,5	-1,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-17,3	-31,4	85,5	6,9	-113,7
a. Mercado spot con el público	-95,0	-25,7	-67,9	-65,3	-178,7
i. Compras	289,0	316,8	324,3	405,8	472,5
ii. (-) Ventas	383,9	342,5	392,2	471,1	651,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	109,3	196,0	92,4	54,6	108,8
i. Pactadas	247,4	372,8	285,5	265,9	382,1
ii. (-) Vencidas	138,0	176,8	193,1	211,3	273,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	83,5	262,0	46,8	-26,1	-3,0
i. Pactadas	132,2	387,5	146,7	175,9	224,6
ii. (-) Vencidas	48,7	125,5	99,8	202,0	227,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	921,0	805,3	685,0	684,1	1088,7
ii. A futuro	144,0	230,0	90,0	10,0	216,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-1,9	39,1	13,6	63,6	34,9
i. Compras	41,4	123,6	90,4	193,7	222,5
ii. (-) Ventas	43,3	85,5	76,8	130,1	187,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-9,8	-95,1	46,6	-0,7	-15,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,7980	2,7922	2,7920	2,7925	2,7843
(*) Datos preliminares					