

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	02 Enero	03 Enero	06 Enero	07 Enero	08 Enero	09 Enero	10 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6 205,3	8 275,6	8 696,2	8 791,6	9 879,2	9 508,1	9 340,2
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	50,0	
Plazo de vencimiento	148,0		248,0		310,0	509,2	
Tasas de interés	3,79		185,4		547,4	354,4	
Mínima	3,65		3,67		3,71	3,66	
Máxima	3,84		3,68		3,75	3,66	
Promedio			3,68		3,73	3,66	
Saldo	19 042,4	19 042,4	19 092,4	19 092,4	19 142,4	16 942,4	16 942,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Enero de 2014			2 250,0				400,0
Vencimientos de CD BCRP del 13 al 17 de Enero de 2014			2 250,0				400,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)							
Propuestas recibidas	2 000,0	4 000,0	3 500,0	2 445,0	2 000,0	1 140,0	1 000,0
Plazo de vencimiento	3 030,0	4 305,0	3 775,0	2 445,0	2 850,0	1 140,0	1 140,0
Tasas de interés	7 d	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Mínima	4,45	4,10	4,05	4,00	4,01	4,00	4,00
Máxima	4,45	4,58	4,47	4,15	4,07	4,05	4,00
Promedio	4,45	4,29	4,21	4,09	4,05	4,02	4,00
Saldo	6 000,0	6 500,0	3 500,0	4 445,0	4 000,0	1 140,0	1 000,0
Próximo vencimiento de Repo el 13 de Enero de 2014			3 500,0				1 000,0
Vencimientos de REPO del 13 al 17 de Enero de 2014			5 000,0				1 000,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)							
Propuestas recibidas	300,0	300,0	300,0	100,0	190,0	225,0	
Plazo de vencimiento	420,0	175,0	315,0	100,0	190,0	225,0	
Tasas de interés	60,0	60,0	59,4	59,4	61,4	61,4	
Mínima	0,08	0,10	0,10	0,15	0,10	0,12	
Máxima	0,15	0,11	0,13	0,15	0,15	0,15	
Promedio	0,11	0,11	0,11	0,15	0,13	0,14	
Saldo	3 411,0	3 586,0	3 316,0	3 246,0	3 061,0	3 061,0	3 061,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 13 de Enero de 2014			170,0				300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR del 13 al 17 de Enero de 2014			770,0				360,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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\$)	0,0	0,0	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	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	11 855,3	12 475,6	11 846,2	11 136,6	11 414,2	10 598,1	10 340,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones							
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)							
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)							
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional							
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	220,8	218,0	243,1	407,0	456,2	670,3
Tasa de interés	3,20%	3,20%	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	11 855,3	12 254,8	11 628,2	10 893,5	11 007,2	10 141,9	9 669,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 190,7	16 190,7	15 389,5	16 190,7	16 076,0	15 986,4	15 995,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,5	17,5	16,9	17,5	17,5	17,5	17,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 371,0	8 262,5	10 154,2	10 816,9	10 827,3	10 849,3	10 731,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,4	12,4	11,1	12,4	11,8	11,8	11,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDRP							
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	144,0	120,0	361,0	260,0	562,0	690,0	659,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,85/4,33	4,20/4,20/4,20	3,95/4,15/4,00	4,00/4,05/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	3,95/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	10,0	50,0	93,0	48,0	48,0	48,0	17,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDRP, CDRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	6,1	51,5
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\$)	31 Diciembre	02 Enero	03 Enero	06 Enero	07 Enero	08 Enero	09 Enero
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	37,7	-53,3	34,7	-36,7	-38,3	-29,8	6,6
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f	47,1	-60,1	41,6	-49,5	-48,0	37,6	36,6
a. Mercado spot con el público	46,4	-255,0	-240,8	-87,1	-134,0	4,9	-17,9
i. Compras	87,4	299,7	270,3	313,5	187,2	368,5	268,0
ii. (-) Ventas	41,0	-514,7	-511,2	-400,7	-321,2	-363,6	-286,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-11,6	-322,5	73,0	-11,8	82,6	44,2	-379,4
i. Pactadas	-2,0	-171,3	238,3	-401,5	285,9	361,1	-128,7
ii. (-) Vencidas	9,5	-493,8	165,3	-413,3	203,3	316,8	-509,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-2,2	-349,3	-23,3	-24,6	92,9	111,6	-349,3
i. Pactadas	0,0	-256,2	91,9	-134,8	326,4	324,0	-117,3
ii. (-) Vencidas	2,2	-605,5	-115,2	-159,4	215,5	212,4	-466,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias							
i. Al contado	0,0	463,0	354,7	567,6	1053,0	500,5	568,3
ii. A futuro	0,0	60,0	105,0	55,0	43,0	152,0	33,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-4,6	178,6	66,7	108,1	103,4	2,8	12,2
i. Compras	0,0	595,6	114,5	146,0	211,1	210,1	463,7
ii. (-) Ventas	6,6	417,0	47,7	246,1	111,7	207,4	451,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	168,0	62,3	-116,2	-45,2	-74,4	0,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera							
Tasa de interés							
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		2,8030	2,8067	2,8068	2,8068	2,8038	2,8016
(*) Datos preliminares							