

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	20 Enero	21 Enero	22 Enero	23 Enero	24 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 755,6	6 199,5	6 524,0	6 557,6	6 519,2
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	
Plazo de vencimiento	293,0		294,0	294,0	
Tasas de interés Mínima	171 d		533 d	350 d	
Máxima	3,66		3,85	3,83	
Promedio	3,83		3,98	3,85	
Saldo	3,79		3,33	3,84	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Febrero de 2014	18 542,4	18 042,4	17 692,4	17 642,4	17 642,4
Vencimientos de CD BCRP entre el 27 y el 31 de Enero de 2014			100,0		2 000,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					0,0
Propuestas recibidas	500,0	500,0	500,0		
Plazo de vencimiento	1 100,0	1 088,0	900,0		
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d		
Máxima	4,25	4,42	4,40		
Promedio	4,25	4,38	4,40		
Saldo	500,0	500,0	500,0		
Próximo vencimiento de Repo			500,0		
Vencimientos de REPO entre el 27 y el 31 de Enero de 2014					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	89,5			300,0	300,0
Plazo de vencimiento	89,5			649,0	443,0
Tasas de interés Mínima	59 d			60 d	61 d
Máxima	0,13			0,03	0,04
Promedio	0,14			0,10	0,09
Saldo	0,13			0,06	0,05
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 31 de Enero de 2014	4 110,5	4 110,5	4 110,5	4 710,5	5 110,5
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 27 y el 31 de Enero de 2014			216,0		216,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	-2,8	0,0	0,0	0,0	-502,5
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	1,0				178,0
iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	2,8120				2,8230
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	6 113,3	6 699,5	6 974,0	5 907,6	5 616,7
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%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	225,7	210,0	305,5	343,1	557,8
	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	5 887,6	6 489,5	6 668,5	5 964,5	5 058,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	14 130,7	14 015,5	13 919,6	13 875,5	13 768,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,3	15,3	15,2	15,2	15,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 885,4	8 780,3	8 684,3	8 683,9	8 532,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,7	9,6	9,5	9,5	9,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,10/4,09	4,00/4,20/4,12	4,16/0,25/4,20	4,00/4,20/4,07	4,05/4,15/4,06
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	72,0	95,0	142,0	133,0	205,0
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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	395,0	300,0	254,5	118,0	90,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					0,5 / 3,74
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 Enero	20 Enero	21 Enero	22 Enero	23 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i. - c.i + e + f	-78,3	121,3	-113,8	67,7	2,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-67,4	117,8	-134,4	-33,9	80,5
a. Mercado spot con el público	-149,4	-114,6	-229,2	-68,6	-171,4
i. Compras	262,7	237,2	216,7	204,8	238,0
ii. (-) Ventas	412,1	351,7	445,9	273,4	409,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	50,3	41,7	-9,5	-39,9	34,6
i. Pactadas	279,4	240,7	224,0	172,3	277,6
ii. (-) Vencidas	229,0	199,0	233,5	212,2	243,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	61,2	38,2	-30,1	-141,6	112,3
i. Pactadas	145,4	44,5	172,7	92,5	273,7
ii. (-) Vencidas	84,1	6,3	202,8	234,1	161,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	715,0	407,0	588,8	964,1	696,0
ii. A futuro	79,0	126,0	110,0	25,0	155,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-51,7	1,8	70,9	56,8	-39,3
i. Compras	83,0	2,8	201,0	233,5	126,6
ii. (-) Ventas	134,7	1,0	130,1	176,7	165,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-11,2	37,9	-6,7	-0,2	209,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8062	2,8096	2,8081	2,8070	2,8099
(*) Datos preliminares					