

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	23 Diciembre	24 Diciembre	26 Diciembre	27 Diciembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>5 226,6</b>	<b>5 109,0</b>	<b>5 431,4</b>	<b>5 373,8</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>				
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR				
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)				
Propuestas recibidas	50,0		50,0	
Plazo de vencimiento	132,6		150,0	
Tasas de interés: Mínima	171 d		350 d	
Máxima	3,56		3,64	
Promedio	3,65		3,75	
Saldo	3,61		3,69	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Enero de 2014	18 892,4	18 892,4	18 942,4	18 942,4
Vencimientos de CD BCRP del 30 de Diciembre de 2013 al 3 de Enero de 2014				2 250,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	2 780,0	1 500,0	1 500,0	500,0
Plazo de vencimiento	2 780,0	1 700,0	1 700,0	900,0
Tasas de interés: Mínima	1 d	2 d	1 d	3 d
Máxima	4,01	4,05	4,08	4,16
Promedio	4,15	4,10	4,15	4,25
Saldo	4,11	4,09	4,11	4,23
Próximo vencimiento de Repo el 30 de Diciembre de 2013	2 780,0	1 500,0	1 500,0	500,0
Vencimientos de REPO del 30 de Diciembre de 2013 al 3 de Enero de 2014				500,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	3 276,0	3 266,0	3 266,0	3 266,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 30 de Diciembre de 2013				210,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR del 30 de Diciembre de 2013 al 3 de Enero de 2014				210,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	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	-50,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				50,0
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
ii. Compras de BTP				
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>7 956,6</b>	<b>6 609,0</b>	<b>6 881,4</b>	<b>5 873,8</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0127%	0,0135%	0,0126%	0,0126%
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	834,8	578,4	514,3	1 572,7
Tasa de interés	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>7 121,8</b>	<b>6 030,6</b>	<b>6 367,1</b>	<b>4 301,1</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 190,7	16 190,7	16 190,7	15 143,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,5	17,5	17,5	16,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 134,9	10 862,6	10 661,1	10 425,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,4	12,4	12,4	11,3
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	992,0	1 012,0	1 194,0	1 493,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	3,90/4,00/4,00	3,95/4,05/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	48,0	80,0	62,0	74,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,16	0,15/0,20/0,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	114,5	0,0	40,3	0,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	60,0 / 3,67			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>20 Diciembre</b>	<b>23 Diciembre</b>	<b>24 Diciembre</b>	<b>26 Diciembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	97,7	-103,1	-22,5	-22,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-141,6	-154,9	34,2	3,1
a. Mercado spot con el público	-275,7	-225,4	-3,5	-50,3
i. Compras	611,5	343,4	70,2	407,9
ii. (-) Ventas	887,2	568,8	73,7	458,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	318,7	2,9	-102,1	-60,9
i. Pactadas	537,5	262,6	28,0	178,5
ii. (-) Vencidas	218,8	259,7	130,1	239,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	79,4	-48,9	-45,4	-35,8
i. Pactadas	196,3	318,7	115,2	145,2
ii. (-) Vencidas	116,9	367,5	160,6	180,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	701,0	740,3	271,5	845,4
ii. A futuro	183,0	158,0	150,0	100,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	61,4	182,5	68,2	22,8
i. Compras	94,4	366,8	159,9	180,4
ii. (-) Ventas	33,0	184,3	91,7	157,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-29,1	-4,1	0,0	-27,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7695	2,7649	2,7832	2,7854
(*) Datos preliminares				