

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	17 Febrero	18 Febrero	19 Febrero	20 Febrero	21 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 483,8	6 104,5	5 693,2	5 082,2	4 918,2
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	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	176,5		142,0	164,0	
Tasas de interés Mínima	171 d		540 d	357 d	
Máxima	3,77		3,97	3,82	
Promedio	3,80		3,97	3,87	
Saldo	3,79		3,97	3,86	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Marzo de 2014	16 042,5	16 042,5	16 072,5	16 102,5	16 102,5
Vencimientos de CD BCRP del 24 al 28 de Febrero de 2014					1 970,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					0,0
Propuestas recibidas	700,0	400,0	500,0	1 000,0	1 000,0
Plazo de vencimiento	1 400	800	1 002	2 012	2 000,0
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,61	4,70	4,75	4,80	4,50
Promedio	4,61	4,74	4,75	4,80	4,73
Saldo	4,61	4,72	4,75	4,80	4,61
Próximo vencimiento de Repo el 24 de Febrero de 2014	500,0	400,0	500,0	1 000,0	1 500,0
Vencimientos de REPO del 21 al 28 de Febrero de 2014					1 500,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					1 500,0
Propuestas recibidas		10,0	295,0		
Plazo de vencimiento		10,0	295,0		
Tasas de interés Mínima		57 d	61 d		
Máxima		0,14	0,04		
Promedio		0,14	0,15		
Saldo		0,14	0,11		
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 28 de Febrero de 2014	4 894,5	4 604,5	4 899,5	4 899,5	4 899,5
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR del 21 al 28 de Febrero de 2014					55,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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
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
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	6 153,8	6 494,5	5 868,2	6 052,2	6 418,2
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%
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	419,6	497,4	568,1	443,5	1 301,9
Tasa de interés	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	5 734,2	5 997,1	5 300,1	5 698,7	5 116,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 024,3	13 024,3	12 577,2	12 577,2	12 437,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,5	14,5	14,1	14,1	13,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 272,0	7 039,0	6 981,1	6 892,6	6 808,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,3	8,3	7,8	7,8	7,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 265,0	1 158,0	1 145,5	1 382,0	1 387,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,05/4,10/4,09	4,00/4,20/4,04	4,10/4,25/4,18	4,00/4,25/4,19	4,15/4,20/4,15
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	75,0	0,0	0,0	19,0	22,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15			0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	120,0	48,0	0,0	65,0	14,0
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\$)	14 Febrero	17 Febrero	18 Febrero	19 Febrero	20 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	152,4	-200,4	-10,5	115,5	-3,6
a. Mercado spot con el público	-40,4	-43,4	-188,2	233,8	-92,1
i. Compras	-127,7	-180,8	-150,5	-19,3	-211,6
ii. (-) Ventas	297,2	159,1	221,6	288,4	285,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	424,9	339,9	372,1	307,7	497,0
i. Pactadas	106,3	-131,8	-131,3	-271,8	-135,4
ii. (-) Ventas	396,4	73,8	306,4	84,2	213,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	290,1	205,6	175,1	356,0	348,6
i. Pactadas	-86,4	25,2	-46,5	-153,5	-223,9
ii. (-) Ventas	38,9	44,4	174,1	163,1	228,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias	185,3	19,3	220,6	316,5	452,2
i. Al contado	772,7	494,2	808,0	567,3	986,5
ii. A futuro	52,0	111,0	161,0	144,0	115,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-12,3	-49,6	113,4	107,7	224,1
i. Compras	78,1	5,9	209,0	310,5	443,3
ii. (-) Ventas	90,4	55,5	95,6	202,9	219,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5,1	0,6	-105,7	106,0	-0,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datafec)	2,8117	2,8012	2,8064	2,8086	2,8084
(*) Datos preliminares					