

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	17 Marzo	18 Marzo	19 Marzo	20 Marzo	21 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6,331.8	6,481.7	5,555.8	5,532.3	5,272.5
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	225.5		232.0	209.5	
Tasas de interés Mínima	178 d		540 d	357 d	
Máxima	3.60		3.65	3.60	
Promedio	3.63		3.67	3.62	
Saldo	3.62		3.67	3.61	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Abril de 2014	14,432.5	14,432.5	14,462.5	14,492.5	14,492.5
Vencimientos de CD BCRP entre el 24 y el 28 de Marzo de 2014					2,040.4
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					0.0
Propuestas recibidas			500.0	500.0	700.1
Plazo de vencimiento			704.0	1,400.0	1,285.3
Tasas de interés Mínima			1 d	1 d	3 d
Máxima			4.06	4.15	4.21
Promedio			4.16	4.15	4.35
Saldo			4.09	4.15	4.28
Próximo vencimiento de Repo el 24 de Marzo de 2014			500.0	500.0	700.1
Vencimientos de REPO entre el 24 y el 28 de Marzo de 2014					700.1
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					700.1
Propuestas recibidas	300.0	300.0	300.0		
Plazo de vencimiento	843.0	598.0	929.0		
Tasas de interés Mínima	63 d	63 d	64 d		
Máxima	0.10	0.07	0.00		
Promedio	0.10	0.13	0.05		
Saldo	0.10	0.10	0.02		
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 24 de Marzo de 2014	4,619.6	4,927.6	4,747.6	4,958.1	4,958.1
Vencimientos de Depósitos Reajustables entre el 24 y el 28 de Marzo de 2014					300.0
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	6,001.8	5,881.7	6,025.8	5,702.3	6,272.5
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	366.1	365.4	362.6	355.0	354.9
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	5,635.7	5,516.3	5,663.2	5,347.3	5,917.6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12,341.9	12,354.2	12,232.1	12,129.6	12,087.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13.6	13.7	13.4	13.4	13.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7,390.1	7,236.8	7,141.2	7,063.4	7,008.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8.0	8.0	7.9	7.8	7.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	885.0	1,333.0	1,347.0	1,330.5	1,311.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,90/4,00/4,00	3,90/4,00/4,00	3,90/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0.0	5.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		0,100/100,10			
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	10.0	20.0	11.2	79.3	0.0
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 Marzo	17 Marzo	18 Marzo	19 Marzo	20 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-143.7	27.0	-132.3	-92.0	33.1
a. Mercado spot con el público	-180.4	15.0	-46.7	-8.8	21.6
i. Compras	-351.3	-305.0	-191.9	-36.8	-226.5
ii. (-) Ventas	347.2	311.1	305.6	393.2	361.1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	696.6	616.1	497.5	430.0	587.6
i. Pactadas	-50.8	-213.8	148.2	20.2	-4.6
ii. (-) Vencidas	372.4	552.5	313.9	168.6	265.6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	423.2	766.3	165.7	148.4	270.2
i. Pactadas	-87.5	-225.9	233.8	103.4	-16.1
ii. (-) Vencidas	86.6	256.3	406.8	218.2	283.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias	174.2	482.2	173.0	114.8	299.5
i. Al contado	1121.6	1199.3	1279.7	891.8	1039.5
ii. A futuro	185.0	100.0	121.0	123.0	175.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	22.2	-11.3	48.5	63.5	205.3
i. Compras	161.4	471.8	170.5	113.8	296.6
ii. (-) Ventas	139.2	483.0	122.1	50.3	91.3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-100.4	47.1	104.0	-69.2	72.1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.8030	2.8072	2.8098	2.8130	2.8125
(*) Datos preliminares					