

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	16 Diciembre	17 Diciembre	18 Diciembre	19 Diciembre	20 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6 539,5	6 249,3	5 757,5	5 445,3	5 559,3
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	110,0	50,0	50,0	2 250,0
Plazo de vencimiento	313,0	110,0	150,0	150,0	0,0
Tasas de interés Mínima	178 d	540 d	357 d	357 d	3 d
Máxima	3,38	3,68	3,55	3,71	4,15
Promedio	3,59	3,68	3,68	3,65	4,21
Saldo	3,50	3,68	3,68	3,65	4,17
Próximo vencimiento de CD BCRP el 9 de Enero de 2014	18 742,4	18 742,4	18 792,4	18 842,4	2 250,0
Vencimientos de CD BCRP del 23 al 27 de Diciembre de 2013					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2 000,0	2 000,0	4 000,0	3 000,0	2 999,9
Propuestas recibidas	3 690,0	2 353,9	4 074,0	5 438,0	2 038,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,10	4,10	4,00	4,00	4,15
Máxima	4,15	4,15	4,11	4,15	4,21
Promedio	4,12	4,11	4,04	4,11	4,17
Saldo	4 000,0	4 000,0	3 000,0	3 000,0	5 037,9
Próximo vencimiento de Repo el 23 de Diciembre de 2013					5 037,9
Vencimientos de Repo del 23 al 27 de Diciembre de 2013					5 037,9
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)			300,0		5 037,9
Propuestas recibidas			310,0		
Plazo de vencimiento			62 d		
Tasas de interés Mínima			0,10		
Máxima			0,15		
Promedio			0,13		
Saldo	2 976,0	2 976,0	3 276,0	3 276,0	3 276,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 23 de Diciembre de 2013					10,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR del 23 al 27 de Diciembre de 2013					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación 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\$)	-50,0	0,0	0,0	0,0	-50,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	50,0				50,0
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	10 489,5	10 249,3	8 407,5	8 395,3	10 597,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0126%	0,0126%	0,0127%
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	388,3	386,8	433,5	583,0	580,8
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	10 101,2	9 862,5	7 974,0	7 812,3	10 016,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 460,4	16 505,4	16 190,7	16 091,0	16 020,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,8	17,9	17,5	17,4	17,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 919,6	11 690,3	11 582,6	11 384,1	11 313,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,7	12,8	12,4	12,3	12,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	734,0	769,5	1 169,0	1 075,0	1 095,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,15/4,10	4,00/4,10/4,02	4,00/4,05/4,00	4,00/4,15/4,01	4,00/4,15/4,05
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	80,0	69,0	49,0	88,0
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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	3,7	153,1	56,0	335,0	3,5
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\$)	13 Diciembre	16 Diciembre	17 Diciembre	18 Diciembre	19 Diciembre
Flujo de la posición ocional = a + b - i - c + e + f	-111,2	-45,1	4,5	-60,2	70,1
a. Mercado spot con el público	-148,4	-166,8	39,7	158,1	-75,7
i. Compras	-251,3	-215,7	7,9	-5,9	-133,1
ii. (-) Ventas	517,6	376,8	362,3	447,6	347,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	769,8	592,6	384,5	453,6	480,4
i. Pactadas	334,5	-112,2	122,9	-28,2	83,5
ii. (-) Vencidas	466,8	414,9	243,4	203,3	333,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	132,3	120,5	120,5	231,5	250,3
i. Pactadas	297,3	233,9	158,0	190,1	-62,4
ii. (-) Vencidas	393,6	397,9	447,7	387,3	231,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	96,3	61,8	289,8	197,2	293,7
ii. A futuro	762,0	603,5	601,2	905,9	1389,3
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	55,0	291,0	135,0	249,0	72,0
i. Compras	68,7	153,7	199,1	5,4	127,4
ii. (-) Ventas	92,7	621,4	279,4	195,7	288,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	24,0	467,7	80,3	190,3	161,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	-1,8	0,0	2,0	124,4	-26,6
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7655	2,7613	2,7640	2,7831	2,7828
(*) Datos preliminares					