

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	23 Diciembre	24 Diciembre	26 Diciembre	27 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 226,6	5 109,0	5 431,4	5 373,8
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	
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				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	7 956,6	6 609,0	6 881,4	5 873,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
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%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	7 121,8	6 030,6	6 367,1	4 301,1
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
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
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)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Diciembre	23 Diciembre	24 Diciembre	26 Diciembre
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				