

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

	(Millones de Nuevos Soles)				
	13 Enero	14 Enero	15 Enero	16 Enero	17 Enero
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>9 688,6</b>	<b>8 849,8</b>	<b>7 609,5</b>	<b>6 550,0</b>	<b>6 082,8</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    200,0    200,0	300,0    500,0	50,0    200,0    400,0	50,0    100,0    100,0	367,9    351,3    428,1
Plazo de vencimiento	420,5    720,5    530,5	780,3    1 248,5	187,0    331,0    684,2	187,0    176,0    7,0	357,0    357,0    7,0
Tasas de interés Mínima	178,0    87,0    7,0	177,0    7,0	540,0    3,72    3,65    3,70	3,66    3,70    3,79	3,66    3,70    3,79
Máxima	3,61    3,60    3,85	3,67    3,86	3,99    3,92    4,00	3,66    3,90    3,86	3,66    3,85    3,83
Promedio	3,56    3,57    3,51	3,64    3,76	3,99    3,82    3,89	3,66    3,85    3,83	3,66    3,85    3,83
Saldo	17 392,4	18 192,4	18 842,4	18 692,4	18 692,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Enero de 2014			400,0		200,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 20 y el 24 de Enero de 2014			400,0		1 200,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	170,0    188,0	300,0	190,0    292,0	180,0	
Propuestas recibidas	170,0    188,0	471,0	190,0    342,0	350,0	
Plazo de vencimiento	59,0    59,0	59,0	61,0    62,0	62,0	
Tasas de interés Mínima	0,14    0,10	0,10	0,11    0,07	0,10	
Máxima	0,15    0,14	0,14	0,15    0,15	0,15	
Promedio	0,14    0,12	0,11	0,14    0,11	0,13	
Saldo	3 119,0	3 359,0	3 841,0	4 021,0	4 021,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 31 de Enero de 2014			216,0		216,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 20 y el 24 de Enero de 2014			0,0		0,0
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>8 880,6</b>	<b>7 749,8</b>	<b>6 477,5</b>	<b>6 120,0</b>	<b>6 082,8</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%	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					
Tasa de interés	4,48%	4,32%	4,48%	4,00%	3,90%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>8 432,5</b>	<b>7 317,6</b>	<b>6 229,4</b>	<b>6 120,0</b>	<b>6 003,8</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 986,4	15 656,3	15 296,8	15 104,7	14 868,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,5	17,1	16,7	16,5	16,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 659,8	10 335,3	10 061,5	9 859,8	9 633,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,8	11,4	11,0	10,8	10,5
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	897,0	1 121,0	898,0	1 564,5	1 719,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,95/4,00/3,99	3,95/4,00/3,99	3,95/4,10/4,00	3,95/4,15/4,01	4,00/4,10/4,04
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	192,0	106,0	168,0	68,1	122,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,15	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	0,0	193,0	48,0	70,0	350,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			30,0 / 3,60	60,0 / 3,65	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					50,0 / 3,65
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>10 Enero</b>	<b>13 Enero</b>	<b>14 Enero</b>	<b>15 Enero</b>	<b>16 Enero</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-111,5	76,5	30,5	-25,8	34,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-181,9	-95,0	164,8	86,4	-28,6
a. Mercado spot con el público	-243,8	-166,7	11,9	-142,0	-132,0
i. Compras	248,2	265,9	300,8	228,7	338,1
ii. (-) Ventas	492,1	432,6	289,0	370,7	470,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	116,1	-4,0	1,1	-118,3	-130,4
i. Pactadas	218,5	206,4	254,0	215,3	224,5
ii. (-) Vencidas	102,3	210,3	252,9	333,7	354,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	45,7	-175,5	135,4	-6,1	-193,8
i. Pactadas	73,6	34,1	247,4	269,6	190,7
ii. (-) Vencidas	27,9	209,6	112,0	275,7	384,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	447,4	506,3	616,8	478,0	664,5
ii. A futuro	65,0	85,0	174,0	174,0	210,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-16,2	50,8	-71,8	-1,4	65,4
i. Compras	24,4	208,3	111,2	253,2	363,7
ii. (-) Ventas	41,3	157,7	183,0	254,7	318,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,4	20,3	83,8	171,9	67,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7978	2,7990	2,8006	2,8049	2,8096
(*) Datos preliminares					