

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	27 Enero	28 Enero	29 Enero	30 Enero	31 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 942.2	5 611.0	6 376.9	5 380.0	5 793.1
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	50.1	0.0	50.0	50.0	50.0
Plazo de vencimiento	342.0	187.0	187.0	216.5	500.0
Tasas de interés: Mínima	164 d	526 d	343 d	343 d	343 d
Máxima	3.73	3.89	3.78	3.89	3.89
Promedio	3.80	4.00	3.98	3.85	3.98
Saldo	17 692.5	17 692.5	17 742.5	17 792.5	17 792.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Febrero de 2014		2 000.0			2 000.0
Vencimientos de CD BCRP entre el 3 y el 7 de Febrero de 2014					2 000.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas		1 000.0		500.0	500.0
Plazo de vencimiento		2 413.0		1 200.0	1 150.0
Tasas de interés: Mínima		7 d		7 d	7 d
Máxima		4.32		4.82	4.36
Promedio		4.46		4.82	4.80
Saldo		1 000.0	1 000.0	1 500.0	2 000.0
Próximo vencimiento de Repo el 4 de Febrero de 2014		1 000.0			1 000.0
Vencimientos de REPO entre el 3 y el 7 de Febrero de 2014					2 000.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	100.0	150.0		100.0	190.0
Plazo de vencimiento	60 d	62 d		61 d	61 d
Tasas de interés: Mínima	0.15	0.15		0.15	0.11
Máxima	0.15	0.15		0.15	0.13
Promedio	0.15	0.15		0.15	0.12
Saldo	5 210.5	5 360.5	5 360.5	5 460.5	5 434.5
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 3 de febrero de 2014		216.0			140.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 3 y el 7 de Febrero de 2014		216.0			190.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-409.3	-409.5	-1 242.5	0.0	-367.0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
Tipo de cambio promedio	145.0	145.0	440.0	130.0	130.0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,823.0	2,823.8	2,823.8	2,823.2	2,823.2
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	5 382.8	6 051.6	5 084.5	5 730.0	5 736.1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0125%	0.0124%	0.0124%	0.0125%	0.0136%
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	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	5 061.7	5 349.8	4 010.0	4 267.2	5 675.3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 285.0	13 527.6	13 127.3	13 047.5	12 369.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14.4	14.4	14.4	14.4	14.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 401.7	8 292.3	7 934.5	7 799.0	7 730.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9.0	9.1	8.7	8.6	8.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.05/4.20/4.08	4.15/5.00/4.31	4.50/4.50/4.50	4.30/4.30/4.30	4.30/4.80/4.47
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	104.0	110.0	100.0	164.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15	0.15/0.15/0.15	0.15/0.20/0.15	0.00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	364.2	320.0	290.0	272.0	180.0
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\$)	24 Enero	27 Enero	28 Enero	29 Enero	30 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	85.2	77.0	-38.8	-18.1	-254.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	235.3	145.6	-59.5	109.6	-125.8
a. Mercado spot con el público	-240.3	-202.8	-296.3	-475.3	-403.5
i. Compras	297.4	338.8	287.4	220.0	252.4
ii. (-) Ventas	537.7	541.6	685.2	695.2	655.9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	5.9	10.2	66.3	50.8	-68.7
i. Pactadas	270.2	217.1	418.5	409.8	369.3
ii. (-) Vencidas	264.3	206.8	350.2	359.0	438.0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	156.0	78.9	45.6	175.4	68.1
i. Pactadas	213.6	172.1	110.4	315.7	223.3
ii. (-) Vencidas	57.5	93.2	61.8	138.3	163.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	781.8	396.6	783.0	383.6	632.2
ii. A futuro	95.0	302.0	162.0	242.0	191.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-56.2	60.2	-242.5	-62.4	-23.6
i. Compras	51.4	92.4	59.2	138.2	151.2
ii. (-) Ventas	107.6	32.2	301.7	200.6	174.8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	325.0	174.6	190.9	426.5	26.5
i. Compras					
ii. (-) Ventas					
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.8216	2.8220	2.8230	2.8238	2.8168
(*) Datos preliminares					