

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	24 Febrero	25 Febrero	26 Febrero	27 Febrero	28 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 263,3	5 815,4	5 811,3	5 941,6	5 250,5
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	192,0		154,5	168,0	
Tasas de interés Mínima	164 d		533 d	350 d	
Máxima	3,67		3,67	3,82	
Promedio	3,77		3,92	3,86	
Saldo	3,73		3,91	3,85	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Marzo de 2014	16 132,5	16 132,5	19 162,5	19 192,5	19 192,5
Vencimientos de CD BCRP entre el 3 y el 7 de Marzo de 2014			1 970,0		1 970,0
Vencimientos de REPO entre el 3 y el 7 de Marzo de 2014			0,0		0,0
ii. Subasta de Certificados de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500,0	500,0			
Plazo de vencimiento	1 000,0	500,0			
Tasas de interés Mínima	7 d	1 d			
Máxima	4,15	4,00			
Promedio	4,18	4,05			
Saldo	4,15	4,02			
Próximo vencimiento de Repo el 3 de Marzo de 2014	1 500,0	1 000,0	1 000,0	1 000,0	500,0
Vencimientos de REPO entre el 3 y el 7 de Marzo de 2014			500,0		500,0
Vencimientos de REPO entre el 3 y el 7 de Marzo de 2014			500,0		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	4 899,5	4 899,5	4 899,5	4 899,5	4 844,5
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 3 de Marzo de 2014			55,0		300,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 3 y el 7 de Marzo de 2014			55,0		875,0
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	6 233,3	5 815,4	5 781,3	5 911,6	5 250,5
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	1 406,2	2 645,1	2 250,4	1 983,1	1 063,2
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	4 827,1	3 170,3	3 530,9	3 828,5	4 887,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 232,1	12 233,6	12 162,4	11 941,9	11 886,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,7	13,7	13,4	13,4	13,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 746,9	6 531,0	6 415,6	6 286,4	6 229,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	7,4	7,2	7,1	7,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 604,0	962,0	924,0	1 152,0	1 059,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,10/4,08	3,90/4,00/3,98	3,90/4,00/3,98	3,85/4,00/3,95	4,00/4,25/4,06
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	39,0	34,0	34,0	63,0	84,0
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	0,10/0,15/0,14
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	262,5	5,0	51,0	21,2
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\$)	21 Febrero	24 Febrero	25 Febrero	26 Febrero	27 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-28,7	-100,1	61,1	73,7	-10,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	69,3	-82,4	9,7	89,3	-99,1
a. Mercado spot con el público	-87,1	-207,6	-123,3	-97,3	-296,0
i. Compras	299,0	279,3	318,5	387,5	331,5
ii. (-) Ventas	386,1	486,9	441,8	484,8	627,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-94,0	-124,8	-25,9	-166,2	51,5
i. Pactadas	174,4	189,8	256,4	343,3	413,0
ii. (-) Vencidas	268,3	314,6	262,2	509,5	361,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	4,0	-107,1	-77,2	-150,6	-36,8
i. Pactadas	122,9	89,3	199,2	184,1	213,7
ii. (-) Vencidas	118,9	196,4	276,4	334,7	250,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	423,2	424,7	652,9	747,0	1029,5
ii. A futuro	180,0	390,0	115,0	110,0	251,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	9,9	15,3	132,3	16,3	82,2
i. Compras	117,2	193,1	274,0	334,3	247,6
ii. (-) Ventas	107,3	177,8	141,8	318,0	165,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2,9	-9,3	-5,0	-4,5	3,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8066	2,8064	2,8071	2,8097	2,8021
(*) Datos preliminares					