

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	3 Marzo	4 Marzo	5 Marzo	6 Marzo	7 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	4,809.0	7,127.8	8,382.6	8,764.6	9,157.6
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	144.0		120.0	197.9	
Tasas de interés Mínima	192 d		554 d	371 d	
Máxima	3.63		3.90	3.77	
Promedio	3.78		4.00	3.77	
Saldo	3.76		3.96	3.77	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 13 de Marzo de 2014	16,222.5	16,222.5	16,252.5	16,282.5	16,282.5
Vencimientos de CD BCRP entre el 10 y el 14 de Marzo de 2014					1,970.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					0.0
Propuestas recibidas	2,000.0	2,000.0	1,300.0	500.0	
Plazo de vencimiento	4,060.0	4,492.0	2,000.0	1,940.0	
Tasas de interés Mínima	7 d	1 d	7 d	1 d	
Máxima	4.36	4.39	4.40	4.25	
Promedio	4.55	4.58	4.68	4.45	
Saldo	4.42	4.46	4.54	4.35	
Próximo vencimiento de Repo el 10 de Marzo de 2014	4,000.0	4,300.0	4,300.0	3,500.0	3,000.0
Vencimientos de REPO entre 10 y 14 de Marzo de 2014					2,000.0
v. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					3,000.0
Propuestas recibidas	208.0				460.0
Plazo de vencimiento	63 d				61 d
Tasas de interés Mínima	0.14				0.15
Máxima	0.15				0.15
Promedio	0.15				0.15
Saldo	4,752.5	4,577.5	4,577.5	4,277.5	4,477.5
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 10 de Marzo de 2014					415.0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 7 y el 14 de Marzo de 2014					1,073.0
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	8,571.0	9,427.8	9,652.6	9,234.6	8,857.6
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%	0.0126%	0.0126%	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	2.8	20.8	106.8	50.8	670.5
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	8,568.2	9,407.0	9,545.8	9,163.8	8,167.1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11,617.7	12,597.3	11,276.6	12,305.6	12,442.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13.7	15.0	13.7	13.7	13.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6,145.0	5,979.6	6,836.4	7,227.7	7,364.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.0	8.3	7.4	8.0	8.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	175.0	438.5	580.0	888.3	951.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.25/4.35/4.33	4.20/4.25/4.25	3.95/4.00/4.00	3.95/4.00/4.00	3.95/4.00/4.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	10.0	15.0	32.0	10.0	47.0
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	0.15/0.15/0.15
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	20.0	0.0	30.0	15.0	35.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					30.0 / 3.75
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Febrero	03 Marzo	04 Marzo	05 Marzo	06 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-1.4	-48.7	-163.3	-65.8	-8.3
a. Mercado spot con el público	23.6	-18.7	-163.5	-24.0	-115.3
i. Compras	-122.5	-185.2	-165.4	-165.4	-184.6
ii. (-) Ventas	426.8	269.9	264.6	251.5	321.3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	549.3	455.1	536.7	416.9	505.8
i. Pactadas	-59.5	-18.8	194.8	96.5	124.0
ii. (-) Ventas	262.6	227.9	490.0	249.9	339.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	322.1	246.6	295.2	213.5	215.9
i. Pactadas	-34.5	3.2	134.6	78.2	17.0
ii. (-) Ventas	294.9	108.6	288.9	164.5	216.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	713.9	493.7	823.8	689.3	845.8
ii. A futuro	206.0	12.0	200.0	235.0	78.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	173.0	54.8	33.6	14.1	144.1
i. Compras	315.3	103.5	149.4	77.8	198.9
ii. (-) Ventas	142.3	48.7	115.8	63.6	54.7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-19.7	-29.5	-65.8	0.0	-91.8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.8000	2.8036	2.8001	2.7983	2.7984
(*) Datos preliminares					