

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	13 Mayo	14 Mayo	15 Mayo	16 Mayo	17 Mayo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	21 191,2	21 794,7	21 124,1	20 866,5	20 030,2
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	100,0 100,0	50,0 100,0	100,0	50,0 100,0	112,0
Plazo de vencimiento	370 d 420 d	186 d 256 d	480 d	237,7 218,2	202,0
Tasas de interés Mínima	3,78 3,72	3,77 3,80	3,75	3,75 3,73	3,69
Máxima	3,85 3,80	3,80 3,89	3,80	3,75 3,74	3,90
Promedio	3,81 3,78	3,79 3,84	3,79	3,75 3,74	3,81
Saldo	<u>26 375,0</u>	<u>26 525,0</u>	<u>26 625,0</u>	<u>26 775,0</u>	<u>26 887,0</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de Junio de 2013)		576,0	576,0		576,0
Vencimientos de CD BCRP del 16 al 17 de mayo de 2013		0,0	0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	6 800,0	3 000,0 3 799,9	3 000,0 4 150,0	5 000,0 1 750,0	4 999,9 1 950,0
Plazo de vencimiento	12 559,2	8 333,5 9 237,5	8 496,0 8 438,6	9 286,3 4 931,8	9 027,6 4 547,2
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Máxima	4,00	3,98 3,95	3,98 3,94	3,96 3,88	3,85 3,85
Promedio	4,05	4,05 4,03	4,01 4,00	4,01 3,98	3,97 3,90
Saldo	<u>6 800,0</u>	<u>6 799,9</u>	<u>7 150,0</u>	<u>6 750,0</u>	<u>6 949,9</u>
Próximo vencimiento de Depósitos (16 de Mayo de 2013)			7 150,0		6 949,9
Vencimientos de Depósitos del 16 al 17 de Mayo de 2013			7 150,0		6 949,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
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	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	14 191,2	14 844,8	13 874,1	13 966,5	12 968,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0135%	0,0134%	0,0134%	0,0133%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	105,0	10,0	26,0	4,5	1,6
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	14 086,2	14 834,8	13 848,1	13 962,0	12 966,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	20 773,4	20 925,8	20 511,7	20 435,8	20 242,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	22,6	22,8	22,3	22,2	22,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	16 610,9	16 228,3	16 069,7	15 977,4	15 800,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,8	18,0	17,5	17,4	17,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,24	4,10/4,25/4,24	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,30/0,40/0,35	0,30/0,35/0,34	0,35/0,35/0,35	0,30/0,35/0,35	0,35/0,35/0,35
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	356,7	1 942,2	855,0	2 625,0	512,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	11,7 / 3,71	52,2 / 3,73	30,0 / 3,75	30,0 / 3,74	98,0 / 3,76
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			10,0 / 3,82		5,0 / 3,72
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 Mayo	13 Mayo	14 Mayo	15 Mayo	16 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	26,1	-77,6	120,5	54,4	-41,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	67,1	11,7	87,4	126,3	123,0
a. Mercado spot con el público	52,7	11,3	91,1	122,1	125,2
i. Compras	350,3	266,9	380,7	407,9	353,7
ii. (-) Ventas	297,7	255,6	289,6	285,8	228,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-65,3	-88,4	-18,6	-9,5	-171,3
i. Pactadas	43,1	125,2	75,4	127,6	84,1
ii. (-) Vencidas	108,4	213,7	94,1	137,1	255,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-24,3	0,9	-51,7	62,5	-7,2
i. Pactadas	166,3	92,7	167,9	163,6	285,2
ii. (-) Vencidas	190,6	91,8	219,6	101,2	292,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	493,5	705,5	583,7	711,0	846,5
ii. A futuro	105,0	185,0	88,0	33,0	75,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	98,3	-118,5	126,9	-31,8	36,8
i. Compras	155,3	87,8	207,1	63,5	283,6
ii. (-) Ventas	57,1	206,3	80,2	95,3	246,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1,7	-2,9	-5,1	0,1	-1,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6038	2,6006	2,5999	2,6159	2,6301
(*) Datos preliminares					