

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

| | 17 Junio | 18 Junio | 19 Junio | 20 Junio | 21 Junio |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 19 999,2 | 19 879,8 | 19 274,0 | 18 983,9 | 18 002,1 |
| 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 | 100,0 | 50,0 | 100,0 | 50,0 | 100,1 |
| Plazo de vencimiento | 357,9 | 195,2 | 181,0 | 186,1 | 277,9 |
| Tasas de interés Mínima | 178 d | 177 d | 267 d | 357 d | 81 d |
| Máxima | 3,95 | 3,97 | 4,00 | 4,00 | 3,95 |
| Promedio | 3,99 | 3,97 | 4,05 | 4,15 | 4,05 |
| Saldo | 3,97 | 3,97 | 4,04 | 4,10 | 4,00 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de Julio de 2013) | 26 761,0 | 26 811,0 | 26 911,0 | 26 961,0 | 27 061,0 |
| Vencimientos de CD BCRP entre el 24 y el 27 de Junio de 2013 | | | 1 200,0 | | 1 200,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | 0,0 | | 0,0 |
| Propuestas recibidas | 6 700,0 | 7 200,0 | 7 300,0 | 6 200,0 | 6 200,0 |
| Plazo de vencimiento | 9 271,8 | 9 405,8 | 9 702,5 | 7 986,1 | 8 182,9 |
| Tasas de interés Mínima | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | 3 d |
| Máxima | 3,94 | 3,95 | 3,99 | 4,00 | 4,00 |
| Promedio | 4,10 | 4,11 | 4,14 | 4,23 | 4,22 |
| Saldo | 4,01 | 4,06 | 4,08 | 4,12 | 4,17 |
| Próximo vencimiento de Depósitos (24 de Junio de 2013) | 6 700,0 | 7 200,0 | 7 300,0 | 6 200,0 | 6 200,0 |
| Vencimientos de Depósitos entre el 24 y el 27 de Junio de 2013 | | | 7 300,0 | | 6 200,0 |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP) | | | | 650,0 | 129,0 |
| Propuestas recibidas | | | | 743,0 | 129,0 |
| Plazo de vencimiento | | | | 61 d | 61 d |
| Tasas de interés Mínima | | | | 0,10 | 0,14 |
| Máxima | | | | 0,19 | 0,24 |
| Promedio | | | | 0,14 | 0,21 |
| Saldo | 630,0 | 630,0 | 630,0 | 1 409,0 | 1 409,0 |
| Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (24 de julio de 2013) | | | 300,0 | | 300,0 |
| Vencimientos de CDR BCRP entre el 24 y el 27 de Junio de 2013 | | | 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 | -400,0 | -100,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | | 400,0 | 100,0 | | |
| 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 | 13 199,2 | 12 629,8 | 11 874,0 | 11 954,9 | 11 702,0 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u> | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0128% | 0,0128% | 0,0128% | 0,0126% | 0,0138% |
| b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u> | | | | | |
| Tasa de interés | 5,05% | 5,05% | 5,05% | 5,05% | 5,05% |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u> | | | | | |
| Tasa de interés | 5,05% | 5,05% | 5,05% | 5,05% | 5,05% |
| d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u> | 3,2 | 7,1 | 11,4 | 0,0 | 7,8 |
| 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 | 13 196,0 | 12 622,7 | 11 862,6 | 11 954,9 | 11 694,2 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 20 204,5 | 20 322,2 | 19 835,7 | 19 684,1 | 19 493,1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 21,9 | 22,1 | 21,5 | 21,4 | 21,2 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 16 263,1 | 15 780,5 | 15 574,3 | 15 408,1 | 15 231,2 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 17,3 | 17,4 | 16,9 | 16,7 | 16,6 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u> | 583,4 | 514,7 | 1 114,0 | 622,0 | 868,7 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,10/4,25/4,24 | 4,15/4,25/4,25 | 4,25/4,30/4,26 | 4,25/4,30/4,26 | 4,25/4,30/4,27 |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u> | 134,3 | 199,8 | 152,4 | 195,7 | 96,9 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,25/0,25/0,25 | 0,25/0,25/0,25 | 0,25/0,25/0,25 | 0,25/0,25/0,25 | 0,25/0,25/0,25 |
| c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u> | 303,4 | 45,4 | 670,0 | 240,3 | 367,7 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | 20,0 / 3,97 | | 14,0 / 4,05 |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | 5,0 / 4,00 | 18,7 / 4,05 |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 14 Junio | 17 Junio | 18 Junio | 19 Junio | 20 Junio |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 32,1 | 44,7 | -0,8 | -38,2 | 183,7 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 45,0 | -10,2 | 2,4 | 29,7 | 377,6 |
| a. <u>Mercado spot con el público</u> | 40,6 | 23,3 | 3,1 | 28,2 | 84,7 |
| i. Compras | 311,9 | 247,2 | 271,3 | 282,3 | 361,2 |
| ii. (-) Ventas | 271,3 | 223,9 | 268,1 | 254,1 | 276,5 |
| b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u> | 59,8 | 14,7 | -16,4 | 81,6 | -297,9 |
| i. Pactadas | 108,0 | 125,2 | 107,1 | 186,7 | 88,9 |
| ii. (-) Vencidas | 48,1 | 110,5 | 123,5 | 105,1 | 386,8 |
| c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u> | 72,7 | -40,3 | -13,2 | 149,4 | -104,0 |
| i. Pactadas | 123,8 | 97,8 | 200,3 | 220,9 | 220,3 |
| ii. (-) Vencidas | 51,1 | 138,1 | 213,4 | 71,5 | 324,3 |
| d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u> | | | | | |
| i. Al contado | 545,0 | 486,2 | 667,3 | 797,3 | 429,7 |
| ii. A futuro | 108,0 | 108,0 | 86,0 | 43,0 | 99,0 |
| e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u> | 4,0 | -11,9 | 93,6 | -29,6 | -49,9 |
| i. Compras | 36,7 | 92,2 | 205,7 | 61,0 | 312,9 |
| ii. (-) Ventas | 32,7 | 104,2 | 112,1 | 90,6 | 362,8 |
| f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u> | 3,3 | 6,0 | -4,4 | -2,7 | 280,4 |
| g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u> | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,7207 | 2,7372 | 2,7435 | 2,7411 | 2,7828 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |