

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	31 Julio	1 Agosto	2 Agosto
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>15 829,2</b>	<b>15 301,8</b>	<b>15 010,7</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>			
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR			
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)		<u>50,0</u>	
Propuestas recibidas		227,8	
Plazo de vencimiento		371 d	
Tasas de interés		4,11	
Mínima		4,15	
Máxima		4,13	
Promedio			
Saldo	<u>25 411,1</u>	<u>25 461,1</u>	<u>25 461,1</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Agosto de 2013)			1 500,1
Vencimientos de CD BCRP del 5 al 9 de Agosto de 2013			1 500,1
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	<u>6 199,9</u>		
Propuestas recibidas	9 216,9		
Plazo de vencimiento	1 d		
Tasas de interés	3,80		
Mínima	4,00		
Máxima	3,97		
Promedio			
Saldo	<u>6 199,9</u>		
Próximo vencimiento de Depósitos			
Vencimientos de Depositos del 5 al 9 de Agosto de 2013			
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	<u>Desierta</u>	<u>40,0</u>	
Propuestas recibidas	10,0	100,0	
Plazo de vencimiento	61 d	61 d	
Tasas de interés	0,20	0,25	
Mínima		0,22	
Máxima			
Promedio			
Saldo	<u>2 146,2</u>	<u>2 186,2</u>	<u>2 186,2</u>
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (9 de Agosto de 2013)			90,0
Vencimientos de CDR BCRP del 5 al 9 de agosto de 2013			90,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>-475,2</u>	<u>-503,3</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US\$)	170,0	180,0	
Tipo de cambio promedio	2,7950	2,7960	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
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	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP			
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>10 104,4</b>	<b>14 708,5</b>	<b>15 010,7</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%	0,0126%	0,0138%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>			
Tasa de interés	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%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>2 667,7</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>7 436,7</b>	<b>14 708,5</b>	<b>15 010,7</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	18 269,7	19 460,0	19 460,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19,8	21,1	21,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	13 986,7	13 775,4	15 198,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,1	16,5	16,5
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	197,0	<u>247,0</u>	<u>375,9</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	1,1	<u>3,5</u>	<u>33,8</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,25/0,25	0,30/0,30/0,30	0,25/0,25/0,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	<u>1 121,9</u>	<u>1 147,7</u>	<u>1 220,7</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			30,0/4,10
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>30 Julio</b>	<b>31 Julio</b>	<b>01 Agosto</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	<b>24,3</b>	<b>-59,6</b>	<b>-70,5</b>
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	<b>38,2</b>	<b>72,0</b>	<b>125,3</b>
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>33,2</b>	<b>-22,1</b>	<b>-82,3</b>
i. Compras	97,5	329,0	183,9
ii. (-) Ventas	64,3	351,0	266,2
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>-35,2</b>	<b>-13,1</b>	<b>-163,5</b>
i. Pactadas	3,7	136,0	108,4
ii. (-) Vencidas	38,9	149,2	272,0
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>-21,3</b>	<b>118,5</b>	<b>32,3</b>
i. Pactadas	3,0	414,8	158,1
ii. (-) Vencidas	24,3	296,3	125,8
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>			
i. Al contado	0,0	309,0	721,2
ii. A futuro	0,0	33,0	206,0
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>	<b>-9,6</b>	<b>155,5</b>	<b>-132,5</b>
i. Compras	11,2	294,7	125,0
ii. (-) Ventas	20,7	139,3	257,5
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	<b>0,0</b>	<b>85,7</b>	<b>194,0</b>
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		2,7936	2,7959
(*) Datos preliminares			