

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	12 Agosto	13 Agosto	14 Agosto	15 Agosto	16 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	18 209,3	18 790,4	17 568,1	16 518,2	15 713,5
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	50,0 100,0	100,0	50,0 100,0	50,0 100,0	
Plazo de vencimiento	402,8 382,6	393,3	310,9 352,9	320,9 280,7	
Tasas de interés Mínima	178 d 178 d	359 d	547 d 358 d	357 d 357 d	
Máxima	3,95 3,93	3,96	3,98 3,96	3,95 3,95	
Promedio	3,99 3,97	4,00	3,98 4,02	3,98 3,97	
Saldo	3,97	3,98	3,98	3,97	3,97
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Setiembre de 2013	24 211,1	22 421,0	22 571,0	22 721,0	22 721,0
Vencimientos de CD BCRP entre 19 y el 23 de Agosto de 2013					1 250,2
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 100,0	4 600,0	3 600,0	2 600,1	2 100,0
Propuestas recibidas	5 622,7	6 512,8	5 950,5	5 125,9	3 767,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,80	3,96	4,00	3,98	3,90
Máxima	4,10	4,18	4,18	4,15	4,10
Promedio	3,97	4,05	4,12	4,11	4,05
Saldo	3 100,0	4 600,0	3 600,0	2 600,1	2 100,0
Próximo vencimiento de Depósitos el 19 de Agosto de 2013					2 100,0
Vencimientos de Depositos entre el 19 y el 23 de Agosto de 2013					2 100,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		110,0	185,0	100,0	30,0
Propuestas recibidas		140,0	185,0	100,0	30,0
Plazo de vencimiento		62 d	62 d	62 d	62 d
Tasas de interés Mínima		0,24	0,24	0,24	0,25
Máxima		0,24	0,25	0,25	0,25
Promedio		0,24	0,24	0,25	0,25
Saldo	2 310,2	2 420,2	2 515,2	2 615,2	2 645,2
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 20 de Agosto de 2013					779,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 19 y el 23 de Agosto de 2013					802,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-195,7	-559,3	-475,5	-503,5	-783,2
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	70,0	200,0	170,0	180,0	280,0
Tipo de cambio promedio	2,7961	2,7963	2,7970	2,7972	2,7971
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	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	14 763,6	13 421,2	13 157,6	13 164,6	12 800,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%	0,0126%	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%	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>	2,8	4,7	5,2	152,9	184,2
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	14 760,8	13 416,5	13 152,4	13 011,7	12 616,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 419,2	19 306,5	19 300,2	19 186,4	19 054,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,0	20,8	20,7	20,6	20,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	14 999,3	15 003,4	14 881,3	14 757,8	14 624,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,2	16,0	16,0	15,9	15,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	543,8	274,3	505,3	491,3	506,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25 / 4,30 / 4,25	4,25 / 4,25 / 4,25	4,25 / 4,30 / 4,26	4,25 / 4,25 / 4,25	4,25 / 4,30 / 4,25
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	41,1	84,1	216,0	174,0	100,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20 / 0,20 / 0,20	0,15 / 0,20 / 0,17	0,10 / 0,15 / 0,11	0,10 / 0,11 / 0,10	0,10 / 0,10 / 0,10
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	40,2	186,3	14,0	189,1	494,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	30,0 / 4,05			35,0 / 3,98	23,7 / 3,97
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	09 Agosto	12 Agosto	13 Agosto	14 Agosto	15 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	65,7	-37,6	17,1	84,4	76,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	6,5	53,2	-74,4	204,1	247,9
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	34,4	-28,0	-317,8	-45,1	25,9
i. Compras	315,1	251,4	214,9	224,9	367,8
ii. (-) Ventas	280,8	279,4	532,7	270,0	341,9
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-115,7	-55,7	101,1	-51,9	-279,7
i. Pactadas	82,1	57,8	161,5	82,4	33,2
ii. (-) Vencidas	197,8	113,4	60,4	134,3	313,0
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-174,9	35,1	9,7	67,8	-108,3
i. Pactadas	23,6	129,3	93,6	167,8	79,8
ii. (-) Vencidas	198,5	94,3	84,0	99,9	188,1
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	583,0	339,5	505,3	296,9	352,5
ii. A futuro	48,0	280,0	113,0	100,0	115,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-4,6	-7,5	28,0	-20,5	-117,0
i. Compras	189,5	91,8	72,4	98,7	154,7
ii. (-) Ventas	194,1	99,3	44,4	119,2	271,7
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-22,7	69,6	239,0	235,4	214,2
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7921	2,7964	2,7972	2,7970	2,7983
(*) Datos preliminares					