

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	30 Setiembre	1 Octubre	2 Octubre	3 Octubre	4 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	13 500,7	12 461,2	12 772,7	12 942,9	13 281,2
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	50,0		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	212,0		230,0	314,6	
Tasas de interés Mínima	164 d		554 d	371 d	
Máxima	3,93		3,95	3,86	
Promedio	3,94		3,95	3,86	
Saldo	3,93		3,95	3,86	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Octubre de 2013	20 913,1	20 913,1	20 963,1	21 013,1	21 013,1
Vencimientos de CD BCRP del 9 al 11 de Octubre de 2013		2 050,0			2 050,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		0,0			2 050,0
Propuestas recibidas	4 649,9				
Plazo de vencimiento	6 406,0				
Tasas de interés Mínima	1 d				
Máxima	4,00				
Promedio	4,22				
Saldo	4,17				
Próximo vencimiento de Depósitos el 2 de Octubre de 2013	4 649,9				
Vencimientos de Depósitos entre el 2 y el 4 de Octubre de 2013					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 9 de Octubre de 2013	2 284,0	2 244,0	2 244,0	2 244,0	2 244,0
Vencimientos de CDR BCRP del 9 al 11 de Octubre de 2013		90,0			124,0
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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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					
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	8 800,8	12 461,2	12 722,7	12 892,9	13 281,2
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%	0,0127%	0,0141%
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>	1 272,0	0,0	0,0	136,0	135,0
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	7 528,8	12 461,2	12 722,7	12 756,9	13 146,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 671,6	17 212,5	16 525,1	17 102,2	17 273,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,3	22,9	20,5	18,8	19,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 116,6	12 461,2	12 461,2	12 592,0	12 730,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,0	16,6	14,6	13,8	14,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	537,0	226,0	220,0	474,0	646,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	168,0	32,0	187,0	168,0	106,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,20/0,15	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. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	4,5	50,5	20,0	190,5	1 012,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	1,0 / 3,89				66,0 / 3,85
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 Setiembre	27 Setiembre	01 Octubre	02 Octubre	03 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	29,5	-121,3	-121,6	91,9	-16,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	114,6	-203,3	-130,0	6,7	-6,9
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	98,7	-227,0	-108,5	-5,9	-10,0
i. Compras	419,1	274,1	221,4	214,5	236,0
ii. (-) Ventas	320,4	501,1	329,9	220,3	246,1
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-81,5	74,1	66,1	37,5	-250,1
i. Pactadas	120,2	138,5	147,4	264,9	35,6
ii. (-) Vencidas	201,7	64,4	81,3	227,5	285,7
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	3,7	-7,9	57,7	-47,7	-240,9
i. Pactadas	80,2	73,2	87,1	106,2	52,6
ii. (-) Vencidas	76,5	81,1	29,3	153,9	293,5
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	378,8	533,5	576,8	574,2	574,2
ii. A futuro	195,0	37,0	135,0	75,0	15,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-103,5	38,6	-39,1	-61,5	19,1
i. Compras	71,3	67,5	28,9	153,2	292,8
ii. (-) Ventas	174,8	29,0	68,0	214,7	273,8
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-5,8	1,8	-34,4	0,5	-8,2
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7655	2,7792	2,7819	2,7787	2,7776
(*) Datos preliminares					