

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	9 Octubre	10 Octubre	11 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	14 583,6	15 825,1	15 680,1
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)	50,0	50,0 100,0 100,0	200,0 100,0
Propuestas recibidas	244,5	374,4 509,0 355,0	824,0 448,0
Plazo de vencimiento	547 d	364 d 364 d 355 d	363 d 181 d
Tasas de interés Mínima	3,90	3,84 3,84 3,80	3,85 3,80
Máxima	3,95	3,85 3,90 3,81	3,92 3,90
Promedio	3,94	3,84 3,87 3,81	3,90 3,84
Saldo	<u>21 063,1</u>	<u>19 263,1</u>	<u>19 563,1</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP el 17 de Octubre de 2013			1 499,8
Vencimientos de CD BCRP entre el 14 y el 18 de Octubre de 2013			1 499,8
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 000,0	5 000,0	5 000,0
Propuestas recibidas	3 985,1	5 936,3	5 680,5
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,80	4,00	4,00
Máxima	4,24	4,24	4,23
Promedio	3,99	4,16	4,18
Saldo	<u>3 000,0</u>	<u>5 000,0</u>	<u>5 000,0</u>
Próximo vencimiento de Depósitos el 14 de Octubre de 2013			5 000,0
Vencimientos de Depositos entre el 14 y el 18 de Octubre de 2013			5 000,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	250,0		
Propuestas recibidas	375,0		
Plazo de vencimiento	61 d		
Tasas de interés Mínima	0,05		
Máxima	0,14		
Promedio	0,08		
Saldo	<u>2 370,0</u>	<u>2 370,0</u>	<u>2 370,0</u>
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 14 de Octubre de 2013			110,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 14 y el 18 de Octubre de 2013			425,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-41,9	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US\$)	15,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	2,7902		
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	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	11 241,8	10 575,1	10 380,1
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%	0,0139%
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>	0,0	0,0	3,3
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	11 241,8	10 575,1	10 376,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	17 255,2	17 239,6	17 093,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,9	18,9	18,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	12 932,3	12 768,2	12 550,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,9	13,9	13,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	417,3	445,8	428,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	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>	135,6	240,7	128,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	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>	401,7	67,5	8,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	1,7 / 3,80		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	07 Octubre	09 Octubre	10 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-0,7	26,5	44,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	71,2	-100,4	0,6
a. <u>Mercado spot con el público</u>	14,6	-172,5	12,6
i. Compras	90,7	254,8	272,3
ii. (-) Ventas	76,1	427,4	259,7
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-108,1	111,9	-60,1
i. Pactadas	-0,2	273,8	276,4
ii. (-) Vencidas	107,9	161,9	336,5
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-36,2	-15,0	-103,9
i. Pactadas	54,7	226,3	220,0
ii. (-) Vencidas	90,9	241,4	323,9
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>			
i. Al contado	0,0	359,6	469,5
ii. A futuro	0,0	25,0	56,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	39,6	86,7	-10,0
i. Compras	78,3	230,2	312,2
ii. (-) Ventas	38,7	143,5	322,2
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	0,0	64,9	-14,6
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		2,7877	2,7820
(*) Datos preliminares			