

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	28 Octubre	29 Octubre	30 Octubre	31 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	16 335,1	16 160,5	15 888,1	15 644,8
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	50,0	100,0
Plazo de vencimiento	250,0	324,0	247,0	368,3
Tasas de interés	164 d	528 d	526 d	372 d
Mínima	3,88	3,90	3,96	3,89
Máxima	3,89	4,00	3,96	3,89
Promedio	3,88	3,97	3,96	3,89
Saldo	<u>20 613,1</u>	<u>20 713,1</u>	<u>20 863,1</u>	<u>20 913,1</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Noviembre de 2013				1 399,9
Vencimientos de CD BCRP el 4 y el 8 de Noviembre de 2013				1 399,9
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	<u>8 300,1</u>	<u>7 960,2</u>	<u>8 559,0</u>	<u>5 492,3</u>
Propuestas recibidas	8 353,3	7 960,2	8 559,0	5 492,3
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	4 d
Tasas de interés	4,17	4,18	4,10	4,10
Mínima	4,25	4,25	4,25	4,25
Máxima	4,24	4,24	4,23	4,19
Promedio	8 300,1	7 960,2	8 559,0	5 492,3
Saldo				5 492,3
Próximo vencimiento de Depósitos el 4 de Noviembre de 2013				5 492,3
Vencimientos de Depositos entre el 4 y el 8 de Noviembre de 2013				5 492,3
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				<u>210,0</u>
Propuestas recibidas				585,0
Plazo de vencimiento				60 d
Tasas de interés				0,08
Mínima				0,15
Máxima				0,13
Promedio	<u>405,0</u>	<u>295,0</u>	<u>295,0</u>	<u>505,0</u>
Saldo				35,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 18 de Noviembre de 2013				0,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 4 y el 8 de Noviembre de 2013				0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>-50,0</u>
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				50,0
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>	<u>0,0</u>
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	7 885,0	8 100,3	7 179,1	9 892,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0140%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	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%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>62,2</u>	<u>12,2</u>	<u>9,9</u>	<u>52,2</u>
Tasa de interés	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	7 822,8	8 088,1	7 169,2	9 840,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 065,1	15 143,6	14 891,8	14 909,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,5	16,6	16,3	16,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 491,8	10 259,7	10 184,8	10 173,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,3	11,4	11,1	11,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	438,5	373,0	470,0	457,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	0,0	0,0	0,0	75,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				0,15/0,15/0,15
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	<u>0,0</u>	<u>80,0</u>	<u>5,0</u>	<u>102,2</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				22,2 / 3,91
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	24 Octubre	28 Octubre	29 Octubre	30 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	38,8	-55,1	10,6	-110,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	42,4	-215,0	3,8	-0,2
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>7,5</u>	<u>-46,4</u>	<u>10,6</u>	<u>-36,3</u>
i. Compras	231,7	192,1	280,7	352,6
ii. (-) Ventas	224,1	238,5	270,0	388,9
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-65,8</u>	<u>168,9</u>	<u>-49,6</u>	<u>-185,9</u>
i. Pactadas	97,6	330,7	143,4	258,0
ii. (-) Vencidas	163,3	161,8	193,0	443,9
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-62,1</u>	<u>9,0</u>	<u>-56,4</u>	<u>-75,4</u>
i. Pactadas	205,0	150,9	96,9	213,9
ii. (-) Vencidas	267,1	141,9	153,3	289,3
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	504,6	474,5	546,7	678,2
ii. A futuro	159,0	180,0	93,0	119,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>145,0</u>	<u>12,2</u>	<u>-7,4</u>	<u>-117,7</u>
i. Compras	266,9	126,0	152,8	284,8
ii. (-) Ventas	121,9	113,8	160,2	402,5
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>-6,3</u>	<u>-200,7</u>	<u>-39,2</u>	<u>-0,8</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7619	2,7601	2,7564	2,7569
(*) Datos preliminares				