

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	3 Junio	4 Junio	5 Junio	6 Junio	7 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	18 608,4	18 847,1	19 059,2	19 570,0	20 204,1
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)					
Propuestas recibidas	0,0	50,0		50,0	
Plazo de vencimiento		167,0		112,6	
Tasas de interés Mínima		191 d		371 d	
Máxima		3,85		3,95	
Promedio		3,90		4,15	
Saldo		3,90		4,03	
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de Junio de 2013)	27 337,0	27 387,0	27 387,0	27 437,0	27 437,0
Vencimientos de CD BCRP del 10 al 14 de Junio de 2013	576,0	576,0	576,0	576,0	576,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	0,0			1 700,0	2 800,0
Propuestas recibidas				6 884,0	7 251,3
Plazo de vencimiento				1 d.	3 d.
Tasas de interés Mínima				3,89	3,88
Máxima				4,00	4,00
Promedio				3,93	3,93
Saldo				1 700,0	2 800,0
Próximo vencimiento de Depósitos (10 de Junio de 2013)					2 800,0
Vencimientos de Depósitos del 10 al 14 de Junio de 2013					2 800,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	540,0	540,0	540,0	540,0	540,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (24 de julio de 2013)	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de CDR BCRP del 10 al 14 de Junio de 2013	0,0		0,0		0,0
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\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	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	18 608,4	18 797,1	19 059,2	17 820,0	17 404,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0129%	0,0130%	0,0129%	0,0128%	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>	334,2	75,9	0,0	0,0	0,0
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	18 274,2	18 721,2	19 059,2	17 820,0	17 404,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 541,1	20 265,3	20 876,3	20 568,1	20 989,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	22,2	22,0	22,6	22,4	22,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	15 098,1	16 003,9	16 614,9	16 614,9	16 727,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,2	17,4	18,0	17,7	18,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	352,0	384,0	855,8	540,4	355,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,35/4,28	4,25/4,30/4,27	4,25/4,30/4,27	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>	52,7	37,7	235,1	79,5	133,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,30/0,30/0,30	0,30/0,30/0,30	0,30/0,35/0,31	0,30/0,30/0,30	0,30/0,30/0,30
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>		1 304,8	1 367,4	1 045,0	1 607,9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			117,4 / 3,93		25,0/3,96
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 Mayo	03 Junio	04 Junio	05 Junio	06 Junio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	82,8	-149,8	-2,4	82,1	-15,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-15,3	-124,2	-70,0	33,6	-3,2
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	-47,2	-142,5	-51,9	18,6	-7,1
i. Compras	348,1	189,3	218,4	213,2	250,4
ii. (-) Ventas	395,3	331,8	270,3	194,5	257,5
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	92,3	-22,5	85,4	54,7	-58,4
i. Pactadas	177,8	60,5	248,8	129,4	64,3
ii. (-) Vencidas	85,5	83,1	163,4	74,7	122,8
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-5,8	3,1	17,7	6,2	-45,9
i. Pactadas	136,8	75,1	217,0	108,6	150,4
ii. (-) Vencidas	142,7	72,0	199,2	102,4	196,3
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	645,8	514,6	669,3	665,3	698,7
ii. A futuro	179,0	33,5	182,0	85,0	157,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	104,5	10,9	34,5	29,4	77,9
i. Compras	140,2	70,7	193,3	101,5	196,1
ii. (-) Ventas	35,7	59,8	158,9	72,1	118,2
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-15,4	-3,7	-16,8	13,3	-0,5
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7351	2,7223	2,7086	2,7141	2,7344
(*) Datos preliminares					