

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	22 Julio	23 Julio	24 Julio	25 Julio	26 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	15 329,2	15 954,1	16 470,0	15 987,6	16 125,6
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	148,1	112,6		127,4	
Tasas de interés Mínima	178,0	177,0		350,0	
Máxima	4,15	4,15		4,15	
Promedio	4,17	4,15		4,18	
Saldo	4,16	4,15		4,17	
Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Agosto de 2013)	25 311,1	25 361,1	25 361,1	25 411,1	25 411,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 31 de Julio y el 2 de Agosto de 2013					1 500,1
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 799,9	3 400,0	4 000,0	4 099,9	4 399,9
Plazo de vencimiento	5 730,9	5 178,6	4 947,6	6 147,1	5 548,7
Tasas de interés Mínima	1,0	1,0	1,0	1,0	1,0
Máxima	4,00	3,99	4,00	4,03	3,95
Promedio	4,09	4,09	4,12	4,10	4,05
Saldo	4,06	4,06	4,06	4,08	4,02
Próximo vencimiento de Depósitos (31 Julio 2013)	2 799,9	3 400,0	4 000,0	4 099,9	4 399,9
Vencimientos de Depósitos entre el 31 de Julio y el 2 de Agosto de 2013					4 399,9
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas			95,0		
Plazo de vencimiento			105,0		
Tasas de interés Mínima			62,0		
Máxima			0,24		
Promedio			0,25		
Saldo			0,25		
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (31 de julio de 2013)	2 591,2	2 591,2	2 386,2	2 386,2	2 386,2
Vencimientos de CDR BCRP entre el 31 de Julio y el 2 de Agosto de 2013					240,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	-30,0	-20,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	30,0	20,0			
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	12 479,3	12 504,1	12 375,0	11 837,7	11 725,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0127%	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0141%
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
Tasa de interés	75,8	73,5	0,0	78,0	226,3
	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	12 403,5	12 430,6	12 375,0	11 759,7	11 499,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 823,0	19 301,6	19 093,5	18 974,6	18 876,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	20,6	21,0	20,7	20,6	20,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	15 117,7	14 797,2	14 694,3	14 597,7	14 478,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,1	16,3	16,0	15,8	15,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	784,4	773,0	612,0	1 059,0	674,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,26	4,25/4,30/4,25	4,25/4,40/4,26	4,25/4,30/4,27	4,25/4,50/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	106,7	151,8	74,8	263,1	145,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,30/0,26	0,25/0,30/0,25	0,25/0,30/0,26	0,25/0,50/0,27	0,14/0,30/0,23
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	1 192,0	1 185,0	285,0	1 562,9	625,9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			50,0 / 4,16	100,0 / 4,16	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		10,0 / 4,16		31,3 / 4,24	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	19 Julio	22 Julio	23 Julio	24 Julio	25 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	66,1	14,2	-20,5	74,2	-70,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-34,1	-3,2	-11,6	-14,3	-74,9
a. Mercado spot con el público	-20,7	-34,8	-6,6	70,1	-133,0
i. Compras	245,7	212,9	252,9	288,3	278,5
ii. (-) Ventas	266,4	247,6	259,5	218,2	411,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	34,4	19,4	-111,3	-17,5	-41,4
i. Pactadas	83,1	158,4	55,7	111,8	200,2
ii. (-) Vencidas	48,7	139,0	167,0	129,3	241,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-65,8	2,0	-102,3	-106,0	-45,6
i. Pactadas	89,0	298,3	101,6	48,6	120,9
ii. (-) Vencidas	154,9	296,3	204,0	154,7	166,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	490,2	269,0	601,5	515,6	446,5
ii. A futuro	11,0	185,0	163,0	146,0	11,3
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	93,7	187,4	30,9	16,5	-16,6
i. Compras	137,7	288,1	192,8	136,7	165,7
ii. (-) Ventas	44,0	100,7	161,9	120,2	182,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,9	1,4	1,0	-75,5	-0,4
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7680	2,7706	2,7787	2,7838	2,7854
(*) Datos preliminares					