

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	16 Setiembre	17 Setiembre	18 Setiembre	19 Setiembre	20 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	15 222,5	14 849,0	13 971,8	13 740,5	13 486,1
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	50,0 100,0	100,0	50,0 100,0 100,0	50,0 100,0	100,0
Plazo de vencimiento	447,3 573,2	366,5	180,0 357,5 367,2	221,3 431,0	212,0
Tasas de interés Mínima	178 d 178 d	86 d	540 d 176 d 85 d	357 d 84 d	83 d
Máxima	3,91 3,95	3,90	4,00 3,90 3,80	3,96 3,86	3,87
Promedio	3,97 3,97	3,98	4,02 3,97 3,94	3,96 3,88	3,98
Saldo	3,95 3,96	3,96	4,01 3,94 3,88	3,96 3,87	3,91
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Octubre de 2013	19 842,1	19 942,1	20 192,1	20 342,1	20 442,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 23 y el 27 de Setiembre de 2013					2 050,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 000,0	4 600,0	4 000,0	4 500,0	4 200,0
Propuestas recibidas	5 684,0	6 350,3	6 391,4	6 361,0	4 831,3
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,75	3,80	3,85	3,85	3,85
Máxima	3,98	4,05	4,00	3,99	4,15
Promedio	3,88	3,92	3,96	3,95	3,95
Saldo	4 000,0	4 600,0	4 000,0	4 500,0	4 200,0
Próximo vencimiento de Depósitos el 23 de Setiembre de 2013					4 200,0
Vencimientos de Depositos entre el 23 y el 27 de Setiembre de 2013					4 200,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		35,0			
Propuestas recibidas		100,0			
Plazo de vencimiento		62 d			
Tasas de interés Mínima		0,15			
Máxima		0,15			
Promedio		0,15			
Saldo	2 344,0	2 379,0	2 379,0	2 379,0	2 379,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 24 de Setiembre de 2013					95,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 23 y el 27 de Setiembre de 2013					95,0
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\$)	0,0	0,0	-20,0	-30,0	
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			20,0	30,0	
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	11 072,5	10 114,0	9 721,8	9 090,5	9 186,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0128%	0,0140%
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>	0,0	27,0	124,0	96,0	15,0
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	11 072,5	10 087,0	9 597,8	8 994,5	9 171,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 999,2	16 996,2	16 785,0	16 630,6	16 506,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,7	18,7	18,5	18,3	18,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	12 630,8	12 426,7	12 289,1	12 139,6	11 991,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,7	13,7	13,5	13,3	13,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	64,0	82,5	324,0	351,5	375,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,23	4,20/4,20/4,20	4,10/4,25/4,24	4,20/4,25/4,21	4,20/5,00/4,21
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	145,6	172,3	158,0	169,0	155,3
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>	35,0	30,0	107,5	103,2	215,7
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	10,0 / 3,95			33,2 / 3,92	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					50,0 / 3,95
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 Setiembre	16 Setiembre	17 Setiembre	18 Setiembre	19 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	47,3	52,9	-5,7	-155,2	76,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	48,6	13,8	-54,6	-12,5	18,3
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	-14,8	-102,7	-128,4	-18,0	-74,6
i. Compras	313,7	326,3	240,6	317,9	277,1
ii. (-) Ventas	328,5	429,1	369,0	335,9	351,6
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	3	-66,8	54,5	-171,8	-52,0
i. Pactadas	169,1	112,0	165,3	175,8	272,0
ii. (-) Vencidas	166,0	178,8	110,8	347,6	324,0
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	4,4	-105,9	5,6	-29,1	-110,2
i. Pactadas	61,2	88,5	131,2	129,2	166,7
ii. (-) Vencidas	56,8	194,4	125,6	158,3	276,9
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	357,2	562,3	583,5	636,5	782,0
ii. A futuro	113,0	137,0	63,0	70,0	35,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-41,5	131,9	80,1	-182,0	46,1
i. Compras	46,0	174,5	114,1	154,4	276,5
ii. (-) Ventas	87,6	42,6	34,0	336,4	230,4
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-4,3	0,2	8,5	-1,9	-0,3
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7745	2,7618	2,7715	2,7696	2,7464
(*) Datos preliminares					