

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	20 Mayo	21 Mayo	22 Mayo	23 Mayo	24 Mayo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	20 452,5	19 965,4	20 032,5	19 919,7	19 920,5
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	100,0	50,0	100,0	50,0	50,0
Plazo de vencimiento	243,0	182,7	252,0	117,1	95,7
Tasas de interés Mínima	353 d	175 d	352 d	350 d	349 d
Máxima	3,78	3,74	3,85	3,80	3,93
Promedio	3,80	3,80	3,85	3,95	3,98
Saldo	3,80	3,78	3,85	3,85	3,97
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de Junio de 2013)	26 987,0	27 137,0	27 137,0	27 187,0	27 237,0
Vencimientos de CD BCRP del 27 al 31 de Mayo de 2013					576,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	5 000,0	2 200,0	5 000,0	3 300,0	5 000,0
Propuestas recibidas	2 200,0	2 200,0	2 900,0	3 300,0	3 499,9
Plazo de vencimiento	7 882,0	4 503,0	5 707,7	4 958,2	9 747,9
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3,89	3,85	3,85	3,82	3,90
Promedio	3,97	3,95	3,95	3,90	4,16
Saldo	3,95	3,87	3,92	3,87	4,07
Próximo vencimiento de Depósitos (27 de Mayo de 2013)	7 200,0	7 200,0	7 900,0	8 300,0	8 499,9
Vencimientos de Depósitos del 27 al 31 de Mayo de 2013					8 499,9
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\$)	-50,0	-50,0	0,0	-50,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	50,0	50,0	50,0	50,0	0,0
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	13 152,5	12 615,4	12 132,5	11 569,7	11 070,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0133%	0,0133%	0,0133%	0,0132%	0,0131%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	8,9	137,0	3,0	4,2	96,1
	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	13 143,6	12 478,4	12 129,5	11 565,5	10 974,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 870,4	20 022,5	19 583,1	19 437,3	19 287,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,6	21,8	21,3	21,2	21,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	15 734,5	15 283,3	15 149,7	15 012,4	14 844,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,8	16,9	16,5	16,3	16,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	531,5	657,0	865,0	850,0	984,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,24	4,25/4,30/4,26	4,20/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	108,8	127,5	108,8	42,2	42,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,35/0,35/0,35	0,30/0,35/0,34	0,30/0,35/0,34	0,25/0,30/0,29	0,30/0,30/0,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	2 311,2	1 638,2	1 856,0	2 056,4	2 148,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	40,0 / 3,80	5,2 / 3,80	20,0 / 3,74	17,0 / 3,78	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 Mayo	20 Mayo	21 Mayo	22 Mayo	23 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	62,6	-68,8	-27,4	14,9	129,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	87,5	-142,6	-34,0	36,3	-3,8
a. Mercado spot con el público	65,3	-109,2	-32,8	47,9	30,2
i. Compras	338,5	288,2	266,5	305,9	320,4
ii. (-) Ventas	273,1	397,4	299,4	257,9	290,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	6,5	-1,1	-15,8	-3,0	-25,4
i. Pactadas	116,7	108,9	202,2	224,5	196,0
ii. (-) Vencidas	110,2	110,0	218,0	227,6	221,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	31,4	-74,9	-22,4	18,3	-159,1
i. Pactadas	108,7	38,0	118,4	141,8	218,3
ii. (-) Vencidas	77,3	112,9	140,8	123,5	375,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	680,0	592,5	953,8	1170,0	234,4
ii. A futuro	130,0	75,0	113,0	60,0	87,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-10,7	-14,4	-70,4	-117,1	123,5
i. Compras	71,3	32,6	139,6	108,9	333,1
ii. (-) Ventas	82,0	106,9	210,0	226,0	209,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-16,1	-7,9	1,3	-3,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6449	2,6431	2,6460	2,6482	2,6674
(*) Datos preliminares					