

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	27 Mayo	28 Mayo	29 Mayo	30 Mayo	31 Mayo
	20 089,4	20 168,8	20 205,0	20 004,8	19 669,8
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR					
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)	0,0	50,0		50,0	0,0
Propuestas recibidas		100,0		177,0	
Plazo de vencimiento		168 d		343 d	
Tasas de interés Mínima		3,90		3,85	
Máxima		4,00		4,00	
Promedio		3,94		3,93	
Saldo	27 237,0	27 287,0	27 287,0	27 337,0	27 337,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de Junio de 2013)		576,0		576,0	
Vencimientos de CD BCRP del 3 al 7 de Junio de 2013		0,0		0,0	
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	5 000,0	3 900,0	5 000,0	3 800,0	8 885,9
Propuestas recibidas	7 558,2	6 118,5	8 573,1	4 646,0	8 885,9
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés Mínima	3,99	4,00	4,00	4,02	3,90
Máxima	4,15	4,10	4,12	4,10	4,23
Promedio	4,08	4,08	4,10	4,06	4,09
Saldo		8 800,0	8 885,9	8 175,2	6 155,5
Próximo vencimiento de Depósitos (3 de Junio de 2013)		8 800,0			6 155,5
Vencimientos de Depósitos del 3 al 7 de Junio de 2013		8 800,0			6 155,5
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	0,0	0,0	0,0	240,0	0,0
Propuestas recibidas				265,0	
Plazo de vencimiento				82 d	
Tasas de interés Mínima				0,14	
Máxima				0,18	
Promedio				0,17	
Saldo	300,0	300,0	300,0	540,0	540,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (24 de julio de 2013)	300,0	300,0			300,0
Vencimientos de Certificados de Depósitos Reajustables del 3 al 7 de Junio de 2013					
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\$)	0,0	-100,0	0,0	0,0	-100,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	100,0			100,0
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	11 189,4	11 318,8	11 319,1	11 539,6	13 514,3
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)	0,0131%	0,0131%	0,0131%	0,0129%	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	7,4	11,6	11,8	8,4	4,2
	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	11 182,0	11 307,2	11 307,3	11 533,2	13 510,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	18 882,9	19 024,0	18 636,4	18 446,7	18 430,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	20,6	20,7	20,3	20,1	20,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	14 700,6	14 579,4	14 187,5	14 003,1	13 987,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,7	15,9	15,4	15,2	15,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	784,5	545,0	758,8	472,0	691,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,27	4,25/4,30/4,30	4,25/4,30/4,27	4,25/4,30/4,27	4,25/4,30/4,28
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	63,8	108,0	91,8	137,4	57,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,30/0,30/0,30	0,30/0,30/0,30	0,30/0,30/0,30	0,30/0,35/0,31	0,30/0,30/0,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	2 056,0	1 687,4	2 100,6	2 097,9	1 057,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			0,6 / 3,93		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	10,0 / 3,80				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	24 Mayo	27 Mayo	28 Mayo	29 Mayo	30 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	87,2	-40,7	-89,9	103,9	89,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	117,5	-135,9	-66,2	53,2	29,7
a. Mercado spot con el público	1,4	-141,8	-70,9	-58,0	-71,7
i. Compras	262,3	215,6	352,2	316,5	279,8
ii. (-) Ventas	261,0	357,4	423,1	374,5	351,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-21,7	94,9	-25,2	25,6	20,3
i. Pactadas	178,7	197,3	99,5	162,1	211,7
ii. (-) Vencidas	200,4	102,4	124,7	136,5	191,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	8,6	-0,2	-1,5	-131,5	-39,3
i. Pactadas	213,7	2,3	126,1	74,7	73,9
ii. (-) Vencidas	205,1	2,5	127,7	206,2	113,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	650,1	789,2	800,1	756,2	824,5
ii. A futuro	33,6	130,0	88,0	117,0	61,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	7,3	-96,8	9,3	73,4	-65,4
i. Compras	183,8	0,5	126,0	194,3	112,4
ii. (-) Ventas	176,5	97,4	116,7	120,9	177,9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	113,5	2,9	-1,6	1,1	88,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6787	2,6770	2,6767	2,6883	2,7201
(*) Datos preliminares					