

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	1 Julio	2 Julio	3 Julio	4 Julio	5 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	16 306,1	15 716,3	15 893,5	15 995,1	15 592,5
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		50,0		50,0	
Plazo de vencimiento		115,1		187,5	
Tasas de interés Mínima		198 d		371 d	
Máxima		4,15		4,28	
Promedio		4,27		4,35	
Saldo		4,23		4,33	
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de Julio de 2013)	27 261,1	27 311,1	27 311,1	27 361,1	27 361,1
Vencimientos de CD BCRP del 8 al 12 de Julio de 2013	1 200,0		1 200,0		1 200,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	0,0		0,0		2 950,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo		0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos			0,0		0,0
Vencimientos de Depósitos del 8 al 12 de Julio de 2013			0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	Desierta	10,0			
Propuestas recibidas	20,0	30,0			
Plazo de vencimiento	63 d	62 d			
Tasas de interés Mínima		0,25			
Máxima		0,25			
Promedio		0,25			
Saldo	2 323,0	2 333,0	2 333,0	2 333,0	2 333,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (24 de julio de 2013)	300,0		300,0		300,0
Vencimientos de CDR BCRP del 8 al 12 de Julio de 2013	0,0		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	-250,7	-83,5	0,0	-279,1
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)		90,0	30,0		100,0
Tipo de cambio promedio		2,7855	2,7837		2,7912
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	16 306,1	15 906,9	15 977,1	15 945,1	15 871,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0138%
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	0,0	0,0	0,0	264,7
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	16 306,1	15 906,9	15 977,1	15 945,1	15 607,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	20 567,9	19 254,0	20 530,5	20 400,0	20 306,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,3	23,2	22,1	22,1	22,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	16 306,1	16 306,6	16 196,8	16 063,4	15 972,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	18,1	17,5	17,4	17,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	406,0	451,0	566,0	503,0	644,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,50/4,30	4,60/4,70/4,62	4,75/4,80/4,75	4,50/4,80/4,71
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	48,1	75,5	97,0	71,0	275,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,25/0,25	0,25/0,25/0,25	0,20/0,25/0,25	0,25/0,30/0,26	0,25/0,30/0,25
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	1 566,0	566,0	902,5	1 225,3	1 325,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Junio	01 Julio	02 Julio	03 Julio	04 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	85,7	-13,1	-94,8	3,9	-39,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	76,2	15,3	104,8	22,4	-69,6
a. <u>Mercado spot con el público</u>	72,7	12,3	5,6	-11,1	-73,4
i. Compras	198,9	288,3	231,7	254,6	166,8
ii. (-) Ventas	126,3	276,0	226,1	265,7	240,3
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-11,7	-48,3	-34,9	-119,6	32,1
i. Pactadas	28,6	108,9	102,5	99,3	43,2
ii. (-) Vencidas	40,4	157,2	137,3	218,9	11,1
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-21,2	-19,9	164,8	-101,1	2,4
i. Pactadas	18,5	190,1	219,9	148,9	63,2
ii. (-) Vencidas	39,7	210,0	55,1	250,0	60,8
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	0,0	241,3	443,0	353,0	101,8
ii. A futuro	0,0	22,0	98,0	58,0	0,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	2,9	55,2	-76,6	34,5	56,3
i. Compras	32,4	203,0	55,0	248,5	59,4
ii. (-) Ventas	29,5	147,8	131,6	214,0	3,1
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	0,0	0,5	93,5	30,1	-2,8
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7815	2,7801	2,7874	2,7856	2,7812
(*) Datos preliminares					