

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 | | | | | |