

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	15 Julio	16 Julio	17 Julio	18 Julio	19 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	17 915,5	17 829,8	16 777,3	16 464,8	15 796,0
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	50,0	50,0	100,0
Plazo de vencimiento	186 d	221,7	222,2	192,0	230,4
Tasas de interés	394,2	221,7	183 d	358 d	215,0
Mínima	4,18	4,09	4,17	4,15	4,17
Máxima	4,20	4,17	4,20	4,17	4,19
Promedio	4,19	4,13	4,18	4,19	4,16
Saldo	24 961,1	25 011,1	25 111,1	25 261,1	25 261,1
Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Agosto de 2013)					1 500,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 22 y el 26 de Julio de 2013					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 400,0	3 500,0	3 000,0	2 700,0	2 500,1
Propuestas recibidas	5 673,3	6 775,9	6 450,7	5 228,3	5 847,2
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés	3,99	4,05	4,05	4,00	4,00
Mínima	4,18	4,18	4,15	4,13	4,10
Máxima	4,10	4,15	4,11	4,11	4,07
Promedio					
Saldo	3 400,0	3 500,0	3 000,0	2 700,0	2 500,1
Próximo vencimiento de Depósitos (22 Julio 2013)					2 500,1
Vencimientos de Depósitos entre el 22 y el 26 de Julio de 2013					2 500,1
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 591,2				
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (24 de julio de 2013)					300,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 22 y el 26 de Julio de 2013					300,0
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\$)					
Tipo de cambio promedio					
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	14 365,5	14 279,8	13 677,3	13 614,8	13 295,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0128%	0,0127%	0,0139%
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	0,0	0,0	173,8	0,0	346,4
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	14 365,5	14 279,8	13 503,5	13 614,8	12 949,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 928,3	19 985,0	19 736,4	19 676,0	19 508,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,6	21,6	21,4	21,3	21,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	15 740,9	15 525,9	15 448,0	15 333,6	15 208,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	16,9	16,7	16,6	16,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	750,7	825,2	773,9	764,7	775,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,25	4,20/4,30/4,26
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	108,3	146,0	131,3	164,7	214,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,30/0,26	0,25/0,30/0,26	0,25/0,30/0,25	0,25/0,30/0,26	0,25/0,30/0,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	21,6	56,7	39,0	570,0	1 080,7
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	6,0 / 4,16				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			5,0 / 4,15		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					35,7 / 4,17
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 Julio	15 Julio	16 Julio	17 Julio	18 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-45,4	-6,8	-43,7	-96,3	84,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	29,4	19,8	14,1	-35,6	-47,1
a. Mercado spot con el público	9,3	30,9	-33,3	-38,6	-123,3
i. Compras	353,4	299,4	217,4	261,3	186,4
ii. (-) Ventas	344,1	268,5	250,8	299,9	309,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-17,1	-53,4	-58,9	-63,4	-19,2
i. Pactadas	92,3	172,7	165,4	91,2	170,7
ii. (-) Vencidas	109,4	226,2	224,3	154,6	189,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	57,8	-26,9	-1,2	-0,7	-150,5
i. Pactadas	129,6	133,1	145,3	81,5	145,7
ii. (-) Vencidas	71,8	160,0	146,5	82,2	296,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	333,1	344,0	349,1	532,0	380,9
ii. A futuro	117,0	35,0	21,0	100,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-18,4	-67,6	-30,3	-73,6	177,5
i. Compras	66,6	114,1	130,7	79,5	295,1
ii. (-) Ventas	85,0	181,6	161,0	153,1	117,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,0	-9,8	-0,1	4,3	5,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7701	2,7651	2,7608	2,7554	2,7675
(*) Datos preliminares					