

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	5 Agosto	6 Agosto	7 Agosto	8 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	15 125,4	15 349,9	15 387,3	16 190,7
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	222,4			329,3
Tasas de interés Mínima	185 d			364 d
Máxima	4,06			4,05
Promedio	4,06			4,05
Saldo	4,06			4,05
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de Agosto de 2013)	<u>25 511,1</u>	<u>25 511,1</u>	<u>25 511,1</u>	<u>24 061,1</u>
Vencimientos de CD BCRP el 9 de Agosto de 2013				1 890,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				0,0
Propuestas recibidas				<u>1 200,0</u>
Plazo de vencimiento				5 361,9
Tasas de interés Mínima				1 d
Máxima				3,80
Promedio				3,95
Saldo				3,92
Próximo vencimiento de Depósitos (9 de Agosto de 2013)				<u>1 200,0</u>
Vencimientos de Depósitos el 9 de Agosto de 2013				1 200,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		<u>90,0</u>	<u>34,0</u>	
Propuestas recibidas		110,0	34,0	
Plazo de vencimiento		2 m	2 m	
Tasas de interés Mínima		0,23	0,24	
Máxima		0,25	0,24	
Promedio		0,25	0,24	
Saldo	<u>2 186,2</u>	<u>2 276,2</u>	<u>2 310,2</u>	<u>2 310,2</u>
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (9 de Agosto de 2013)				90,0
Vencimientos de CDR BCRP el 9 de agosto de 2013				90,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0,0</u>	<u>-28,0</u>	<u>-587,5</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)		10,0	210,0	
Tipo de cambio promedio		2,7955	2,7977	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
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	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
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	15 075,4	15 321,9	14 765,8	14 940,7
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%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	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%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Tasa de interés	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	15 075,4	15 321,9	14 765,8	14 940,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 460,0	19 460,0	19 460,0	21,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,1	21,1	21,1	15 198,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	14 859,6	14 963,2	15 023,0	16,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,5	16,5	16,5	16,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>580,5</u>	<u>248,5</u>	<u>513,8</u>	<u>358,5</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20 / 4,30 / 4,25	4,25 / 4,25 / 4,25	4,25 / 4,30 / 4,25	4,25 / 4,25 / 4,25
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>96,2</u>	<u>47,7</u>	<u>53,3</u>	<u>39,2</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20 / 0,25 / 0,25	0,20 / 0,25 / 0,22	0,20 / 0,20 / 0,20	0,20 / 0,20 / 0,20
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	<u>1 020,0</u>	<u>605,1</u>	<u>162,7</u>	<u>393,0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		42,4 / 4,05		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	02 Agosto	05 Agosto	06 Agosto	07 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-2,3	-27,9	8,1	97,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-37,6	-36,6	59,5	130,4
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>-103,0</u>	<u>1,4</u>	<u>-30,3</u>	<u>-121,4</u>
i. Compras	191,8	208,3	147,8	197,7
ii. (-) Ventas	294,8	206,9	178,1	319,2
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>20,4</u>	<u>30,4</u>	<u>-30,5</u>	<u>75,0</u>
i. Pactadas	188,7	111,7	220,7	117,5
ii. (-) Vencidas	168,3	81,4	251,2	42,5
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-14,9</u>	<u>21,7</u>	<u>20,9</u>	<u>108,1</u>
i. Pactadas	94,2	98,3	78,7	216,2
ii. (-) Vencidas	109,1	76,6	57,7	108,0
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	609,5	299,7	291,3	454,5
ii. A futuro	145,0	143,0	34,0	100,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>16,8</u>	<u>-42,6</u>	<u>-150,7</u>	<u>76,0</u>
i. Compras	108,8	32,2	37,2	97,8
ii. (-) Ventas	91,9	74,8	187,9	21,8
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>-10,6</u>	<u>-0,1</u>	<u>47,1</u>	<u>241,4</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7878	2,7917	2,7958	2,7995
(*) Datos preliminares				