

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	26 Agosto	27 Agosto	28 Agosto	29 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	12 472,8	12 397,9	12 373,1	10 608,5
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	50,0
Plazo de vencimiento	121,9		112,3	58,8
Tasas de interés	164 d		533 d	343 d
Mínima	3,86		4,02	3,97
Máxima	4,15		4,02	4,25
Promedio	4,04		4,02	4,23
Saldo	<u>22 921,0</u>	<u>22 921,0</u>	<u>22 971,0</u>	<u>23 021,0</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Setiembre de 2013				1 250,2
Vencimientos de CD BCRP entre el 2 y el 6 de Setiembre de 2013				0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				<u>730,0</u>
Propuestas recibidas				730,0
Plazo de vencimiento				4 d
Tasas de interés				4,95
Mínima				5,25
Máxima				4,43
Promedio				<u>730,0</u>
Próximo vencimiento de Repo el 2 de Setiembre de 2013				730,0
Vencimientos de Repo entre el 2 y el 6 de Setiembre de 2013				730,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas	<u>530,0</u>	<u>110,0</u>		
Plazo de vencimiento	530,0	110,0		
Tasas de interés	63 d	63 d		
Mínima	0,09	0,15		
Máxima	0,25	0,25		
Promedio	0,14	0,22		
Saldo	<u>2 665,2</u>	<u>2 612,2</u>	<u>2 612,2</u>	<u>2 612,2</u>
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 2 de Setiembre de 2013				10,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 2 y el 6 de Setiembre de 2013				10,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>-379,5</u>	<u>-492,3</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)	135,0	175,0		
Tipo de cambio promedio	2,8114	2,8130		
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	<u>-25,0</u>	<u>-25,0</u>	<u>-50,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	25,0	25,0	50,0	
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	11 513,2	10 795,6	10 823,1	11 288,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0139%
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>740,0</u>	<u>516,0</u>	<u>1 333,1</u>	<u>1 150,0</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	10 773,2	10 279,6	9 490,0	10 138,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	18 293,6	14 816,2	18 153,3	18 056,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19,8	16,0	19,6	19,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	13 864,4	13 769,5	13 640,2	13 519,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,9	11,1	14,7	14,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	1 028,0	995,5	1 161,0	649,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,55/4,50	4,35/4,40/4,36	4,25/4,55/4,35	4,25/5,25/4,55
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	0,0	0,0	13,0	6,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	1 621,5	2 276,5	705,4	944,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	30,0 / 4,00	10,0 / 4,00	15,0 / 4,05	2,0 / 4,02
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 Agosto	26 Agosto	27 Agosto	28 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	8,9	-20,7	23,1	67,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-141,6	-30,6	28,0	-342,1
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	-190,9	-203,7	-158,4	-378,4
i. Compras	267,0	270,2	263,3	356,3
ii. (-) Ventas	457,9	473,9	421,8	734,7
b. <u>Operaciones forward al público (con y sin entrega)</u>	155,8	-87,8	79,8	167,6
i. Pactadas	201,8	198,1	176,5	419,9
ii. (-) Vencidas	46,0	286,0	96,8	252,3
c. <u>Operaciones forward al público (con y sin entrega)</u>	5,2	-97,7	84,7	-241,7
i. Pactadas	48,7	85,4	192,5	194,0
ii. (-) Vencidas	43,5	183,1	107,9	435,7
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	532,9	440,2	527,5	902,7
ii. A futuro	168,0	75,0	90,0	236,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	16,0	8,7	57,6	230,7
i. Compras	34,0	172,9	107,5	427,5
ii. (-) Ventas	18,0	164,2	49,9	196,8
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	30,9	61,6	139,9	-10,9
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8119	2,8119	2,8125	2,8088
(*) Datos preliminares				