

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	9 Setiembre	10 Setiembre	11 Setiembre	12 Setiembre	13 Setiembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>10 410,1</b>	<b>12 077,1</b>	<b>12 646,3</b>	<b>15 347,7</b>	<b>14 977,2</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
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	274,1		185,9	325,8	
Tasas de interés Mínima	185 d		547 d	364 d	
Máxima	4,00		4,05	3,99	
Promedio	4,01		4,10	4,03	
Saldo	4,01		4,07	4,00	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Octubre de 2013	<u>23 221,0</u>	<u>21 970,8</u>	<u>22 020,8</u>	<u>19 692,1</u>	<u>19 692,1</u>
Vencimientos de CD BCRP entre el 16 y el 20 de Setiembre de 2013			2 378,7		2 050,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			2 378,7		0,0
Propuestas recibidas	2 000,0				
Plazo de vencimiento	2 575,0				
Tasas de interés Mínima	1 d				
Máxima	4,43				
Promedio	4,51				
Saldo	4,49				
Próximo vencimiento de Repo el 11 de Setiembre de 2013	<u>2 000,0</u>				
Vencimientos de Repo entre el 11 y el 13 de Setiembre de 2013					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 24 de Setiembre de 2013	<u>2 602,2</u>	<u>2 344,0</u>	<u>2 344,0</u>	<u>2 344,0</u>	<u>2 344,0</u>
Vencimientos de CDR BCRP entre el 16 y el 20 de Setiembre de 2013			95,0		95,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>-50,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			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>	<u>0,0</u>
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>12 360,1</b>	<b>12 077,1</b>	<b>12 596,3</b>	<b>12 297,7</b>	<b>11 777,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0127%	0,0139%
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>	<u>220,0</u>	<u>224,0</u>	<u>224,0</u>	<u>274,0</u>	<u>0,0</u>
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>12 140,1</b>	<b>11 857,1</b>	<b>12 372,3</b>	<b>12 023,7</b>	<b>11 777,2</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	17 158,9	16 959,2	17 373,4	17 252,4	17 202,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,9	18,7	19,1	19,0	18,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	12 509,7	12 907,8	12 859,2	12 763,6	12 687,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,9	13,7	14,2	14,0	14,0
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>351,5</u>	<u>337,0</u>	<u>288,0</u>	<u>352,0</u>	<u>509,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,25/4,35/4,28	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,05/4,25/4,17
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>89,9</u>	<u>101,9</u>	<u>143,9</u>	<u>120,0</u>	<u>113,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	<u>50,4</u>	<u>1 193,5</u>	<u>1 509,0</u>	<u>37,0</u>	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		39,7 / 4,00		26,0 / 4,0	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>06 Setiembre</b>	<b>09 Setiembre</b>	<b>10 Setiembre</b>	<b>11 Setiembre</b>	<b>12 Setiembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-68,9	-24,7	-103,7	121,9	-30,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-115,6	-175,3	-203,1	38,5	4,4
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	<u>-220,4</u>	<u>-183,2</u>	<u>-111,7</u>	<u>33,7</u>	<u>-36,9</u>
i. Compras	195,1	240,5	264,7	332,5	354,2
ii. (-) Ventas	415,5	423,7	376,5	298,8	391,1
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>76,2</u>	<u>26,6</u>	<u>90,2</u>	<u>59,7</u>	<u>36,0</u>
i. Pactadas	226,3	191,2	201,4	225,5	256,6
ii. (-) Vencidas	150,1	164,6	111,2	165,8	220,6
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>29,5</u>	<u>-124,0</u>	<u>-9,2</u>	<u>-23,8</u>	<u>70,7</u>
i. Pactadas	65,1	138,8	89,1	103,8	178,3
ii. (-) Vencidas	35,6	262,8	98,4	127,6	107,6
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	391,9	532,8	669,0	551,2	620,2
ii. A futuro	92,0	120,0	83,0	14,0	111,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-6,9</u>	<u>106,1</u>	<u>-6,6</u>	<u>-28,4</u>	<u>-72,5</u>
i. Compras	24,6	190,2	85,8	121,7	84,7
ii. (-) Ventas	31,5	84,1	92,4	150,0	157,3
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>-2,9</u>	<u>-0,1</u>	<u>-97,6</u>	<u>-5,1</u>	<u>0,9</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8042	2,7968	2,7953	2,7868	2,7719
(*) Datos preliminares					