

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	14 Octubre	15 Octubre	16 Octubre	17 Octubre	18 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	15 184,6	14 859,1	14 740,1	15 787,9	15 018,1
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	50,0 300,0	100,0 200,0	50,0 199,9	50,0 100,0 200,0	199,9
Plazo de vencimiento	374,0 910,0	335,0 510,0	203,0 761,0	415,0 305,0 1 044,2	705,5
Tasas de interés Mínima	178 d 360 d	541 d 359 d	540 d 358 d	357 d 539 d 357 d	356 d
Máxima	3,81 3,92	3,90 3,81	3,89 3,91	3,92 3,95 3,89	3,91
Promedio	3,81 4,00	4,10 4,00	3,97 3,98	3,93 4,07 3,94	3,93
Saldo	3,81 3,96	3,96 3,93	3,97 3,92	3,93 4,01 3,92	3,93
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Noviembre de 2013	19 913,1	20 213,1	20 463,0	19 313,2	19 513,1
Vencimientos de CD BCRP entre el 21 y el 25 de Octubre de 2013		1 499,8		1 399,9	1 399,9
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		1 499,8		0,0	0,0
Propuestas recibidas	5 000,0	5 100,1	5 349,9	6 650,1	6 000,0
Plazo de vencimiento	6 864,4	6 565,1	7 023,9	7 917,9	6 311,3
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,10	4,10	4,15	4,15	4,14
Promedio	4,23	4,23	4,23	4,23	4,25
Saldo	4,19	4,20	4,21	4,21	4,20
Próximo vencimiento de Depósitos el 21 de Octubre de 2013	4 999,9	5 100,1	5 349,9	6 650,1	6 000,0
Vencimientos de Depósitos entre el 21 y el 25 de Octubre de 2013		5 100,1		6 650,1	6 000,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		5 100,1		6 650,1	6 000,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 260,0	2 075,0		1 945,0	1 945,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 21 de Octubre de 2013		100,0		720,0	720,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 21 y el 25 de Octubre de 2013		130,0		0,0	1 020,0
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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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	9 834,7	9 459,0	9 140,3	8 787,8	8 818,2
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%	0,0127%	0,0128%	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	57,0	93,7	3,9	3,3	21,7
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	9 777,7	9 365,3	9 136,4	8 784,5	8 796,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	14 320,0	16 694,7	16 256,0	16 087,4	15 945,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,7	18,3	17,8	17,6	17,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	12 351,4	12 152,4	11 717,5	11 545,0	11 402,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,7	13,3	12,8	12,6	12,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	377,0	316,0	581,0	692,0	795,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	217,2	79,5	72,5	43,7	10,0
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. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	54,0	72,0	110,0	95,1	128,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	19,0 / 3,80	59,0 / 3,80		3,0 / 3,82	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	10,0 / 3,85		55,0 / 3,86	36,1 / 3,95	43,0 / 3,90
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Octubre	14 Octubre	15 Octubre	16 Octubre	17 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	22,2	40,7	-124,2	82,1	16,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-71,1	52,8	-114,0	-36,4	-24,4
a. Mercado spot con el público	-85,1	87,1	-32,8	38,5	-15,8
i. Compras	256,3	268,9	256,6	281,1	310,8
ii. (-) Ventas	341,5	181,8	289,5	242,7	326,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	70,9	5,8	24,7	118,4	34,9
i. Pactadas	176,8	38,1	184,5	221,7	236,6
ii. (-) Vencidas	105,8	32,3	159,8	103,3	201,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-22,4	17,9	34,9	-0,1	-5,6
i. Pactadas	118,1	38,5	210,1	72,2	232,1
ii. (-) Vencidas	140,5	20,6	175,2	72,4	237,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	730,5	303,1	492,5	493,9	726,5
ii. A futuro	85,0	0,0	5,0	47,0	153,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	48,7	-1,7	7,2	-11,5	62,3
i. Compras	134,7	20,0	150,8	69,5	233,8
ii. (-) Ventas	86,0	21,7	143,6	81,0	171,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-44,4	-73,0	-94,3	-34,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7709	2,7715	2,7683	2,7619	2,7550
(*) Datos preliminares					