

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	21 Octubre	22 Octubre	23 Octubre	24 Octubre	25 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	15 488,3	15 537,9	15 265,3	15 301,0	15 342,9
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)	50,0	200,0	100,0	200,0	50,0
Propuestas recibidas	288,5	589,0	387,0	682,0	280,0
Plazo de vencimiento	171 d	353 d	534 d	351 d	350 d
Tasas de interés Mínima	3,81	3,90	3,95	3,85	3,91
Máxima	3,88	3,90	3,95	3,85	3,84
Promedio	3,85	3,90	3,95	3,85	3,84
Saldo	19 763,1	20 063,1	20 313,1	20 463,1	20 463,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Noviembre de 2013					1 399,9
Vencimientos de CD BCRP entre el 28 y el 31 de Octubre de 2013		0,0			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	6 595,9	6 750,0	6 471,2	7 000,1	6 734,2
Propuestas recibidas	6 595,9	7 495,9	6 471,2	7 507,2	6 734,2
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,14	4,16	4,16	4,19	4,17
Máxima	4,25	4,25	4,25	4,25	4,25
Promedio	4,22	4,23	4,23	4,24	4,23
Saldo	6 595,9	6 750,0	6 471,2	7 000,1	6 734,2
Próximo vencimiento de Depósitos el 28 de Octubre de 2013					6 734,2
Vencimientos de Depósitos entre el 28 y el 31 de Octubre de 2013					6 734,2
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (GDR BCRP)	10,0				
Propuestas recibidas	20,0				
Plazo de vencimiento	63 d				
Tasas de interés Mínima	0,15				
Máxima	0,15				
Promedio	0,15				
Saldo	1 235,0	935,0	935,0	935,0	935,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 28 de Octubre de 2013					530,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 28 y el 31 de Octubre de 2013					640,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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		-50,0	0,0	0,0	-50,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		50,0			50,0
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	8 632,4	8 487,9	8 544,1	8 150,9	8 608,7
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%	0,0127%	0,0140%
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	35,2	50,4	52,5	31,3	31,9
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	8 597,2	8 437,5	8 491,6	8 119,6	8 576,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 563,8	15 663,9	15 549,6	15 401,0	15 154,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,1	17,2	17,0	16,9	16,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 248,9	11 121,1	10 777,6	10 678,2	10 420,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,1	12,2	12,1	11,7	11,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	720,3	565,5	722,4	473,0	462,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,23	4,20/4,30/4,25	4,17/4,25/4,25	4,17/4,25/4,24
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	33,0	30,0	15,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	99,0	125,3	110,0	57,0	52,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	18 Octubre	21 Octubre	22 Octubre	23 Octubre	24 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	94,0	-215,7	-60,8	-24,4	38,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	49,2	-213,3	-168,8	-42,5	42,4
a. Mercado spot con el público	34,3	34,1	-65,5	-69,4	7,5
i. Compras	323,2	252,6	172,2	144,7	231,7
ii. (-) Ventas	288,9	218,5	237,8	214,1	224,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	36,1	-20,4	139,4	73,2	-65,8
i. Pactadas	158,9	159,4	320,3	112,5	97,6
ii. (-) Vencidas	122,8	179,8	180,9	39,3	163,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-8,6	-17,9	31,4	55,1	-82,1
i. Pactadas	73,0	80,0	180,0	238,5	205,0
ii. (-) Vencidas	81,6	97,9	148,6	183,3	267,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	348,0	451,0	574,2	394,5	504,6
ii. A futuro	101,0	10,0	95,0	186,0	159,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-27,8	-76,5	-17,1	158,1	145,0
i. Compras	77,2	90,4	148,3	182,4	266,9
ii. (-) Ventas	105,0	167,0	165,4	24,3	121,9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,6	-252,8	-118,5	13,0	-6,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,7650	2,7765	2,7637	2,7640	2,7619
(*) Datos preliminares					