

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	04 Noviembre	05 Noviembre	06 Noviembre	07 Noviembre	08 Noviembre	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	14 308,5	14 397,6	13 867,8	16 164,1	15 814,2	
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	197,0		194,0	367,0		
Tasas de interés	185 d		547 d	364 d		
Mínima	3,86		3,96	3,88		
Máxima	3,89		3,99	3,88		
Promedio	3,67		3,98	3,88		
Saldo	20 963,1	20 963,1	21 013,1	19 663,2	19 663,2	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Noviembre de 2013		1 399,9		700,0	700,0	
Vencimientos de CD BCRP entre el 11 y el 15 de Noviembre de 2013		1 399,9		0,0	700,0	
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)		170,0	400,0	170,0	300,0	300,0
Propuestas recibidas	280,0	400,0	205,0	500,0	392,0	
Plazo de vencimiento	62 d	62 d	62 d	62 d	61 d	
Tasas de interés	0,10	0,07	0,14	0,07	0,10	
Mínima	0,15	0,15	0,15	0,15	0,10	
Máxima	0,11	0,10	0,15	0,09	0,10	
Promedio						
Saldo	505,0	1 075,0	1 245,0	1 545,0	1 845,0	
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 18 de Noviembre de 2013		35,0		35,0	35,0	
Vencimientos de CDR BCRP entre el 11 y el 15 de Noviembre de 2013		0,0		0,0	0,0	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR						
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	-2,8	-14,0	
Tipo de cambio promedio						
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	1,0	5,0	
Tipo de cambio promedio				2,7970	2,8032	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	
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						
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	
ii. Compras de BTP						
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	14 258,5	13 827,6	13 647,8	13 811,3	13 700,2	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)						
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0125%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)						
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	4,80%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional						
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	4,80%	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	160,0	0,0	0,0	0,0	
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,20%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	14 258,5	13 667,6	13 647,8	13 811,3	13 700,2	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 680,4	15 524,5	16 209,7	16 635,6	16 895,3	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,4	18,0	17,5	18,0	18,3	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 076,4	10 794,7	11 489,4	11 821,1	12 080,5	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,8	12,5	12,3	12,8	13,1	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	349,0	701,0	692,5	475,7	623,3	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,00/4,05/4,00	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	169,0	191,0	161,0	163,0	153,5	
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	259,4	57,2	0,0	62,4	49,0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		40,0 / 3,86			49,0 / 3,88	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		2,2 / 3,90				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)						
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 Octubre	04 Noviembre	05 Noviembre	06 Noviembre	07 Noviembre	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	132,7	-82,4	57,6	-21,6	3,9	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	150,1	20,7	206,7	115,2	261,9	
a. Mercado spot con el público	75,9	-9,8	-2,6	51,4	131,3	
i. Compras	359,9	306,1	223,4	303,9	384,9	
ii. (-) Ventas	284,0	315,9	226,0	252,5	253,7	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	131,8	8,1	-20,2	76,4	-140,1	
i. Pactadas	171,9	160,8	126,1	248,8	127,0	
ii. (-) Vencidas	40,1	152,6	146,3	172,4	267,1	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	149,2	111,2	128,9	213,3	118,0	
i. Pactadas	328,2	151,6	250,5	257,0	237,2	
ii. (-) Vencidas	179,0	40,3	121,6	43,7	119,2	
d. Operaciones cambiarias interbancarias						
i. Al contado	460,9	386,0	569,0	530,5	720,3	
ii. A futuro	70,0	63,0	95,0	105,8	12,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	147,5	-96,9	-22,4	-117,8	-129,4	
i. Compras	172,4	38,3	118,2	42,2	118,1	
ii. (-) Ventas	24,9	135,2	140,6	160,0	247,6	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	65,7	15,0	207,0	52,9	112,2	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7745	2,7774	2,7924	2,7895	2,7939	
(*) Datos preliminares						