

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	11 Noviembre	12 Noviembre	13 Noviembre	14 Noviembre	15 Noviembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>15 836,6</b>	<b>15 783,6</b>	<b>15 825,0</b>	<b>15 148,0</b>	<b>15 041,3</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)	50,0	100,0	50,1	100,0	100,0
Propuestas recibidas	382,6	656,0	341,0	565,0	523,5
Plazo de vencimiento	178 d	1 d	540 d	358 d	356 d
Tasas de interés					
Mínima	3,62	3,70	3,66	3,65	3,62
Máxima	3,75	3,70	3,73	3,65	3,62
Promedio	3,68	3,70	3,72	3,65	3,62
Saldo	19 713,2	19 113,2	19 263,3	19 413,3	19 513,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Diciembre de 2013					1 621,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 18 y el 22 de Noviembre de 2013					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 400,0	4 800,0	5 200,1	4 999,9	4 900,1
Propuestas recibidas	6 716,8	6 842,4	6 576,3	6 477,5	6 428,2
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés					
Mínima	3,80	3,85	3,85	3,88	3,89
Máxima	3,97	3,96	3,95	3,95	3,94
Promedio	3,83	3,94	3,94	3,93	3,92
Saldo	3 400,0	4 800,0	5 200,1	4 999,9	4 900,1
Próximo vencimiento de Depósitos el 18 de Noviembre de 2013					4 900,1
Vencimientos de Depósitos entre el 18 y el 22 de Noviembre de 2013					4 900,1
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	300,0	60,0			106,0
Propuestas recibidas	408,0	85,0			106,0
Plazo de vencimiento	63 d	63 d			77 d
Tasas de interés					
Mínima	0,09	0,10			0,08
Máxima	0,13	0,14			0,12
Promedio	0,10	0,13			0,10
Saldo	2 145,0	2 205,0	2 205,0	2 205,0	2 311,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 18 de Noviembre de 2013					35,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 18 y el 22 de Noviembre de 2013					35,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	-112,1	-14,0	-336,1	0,0	-28,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	40,0	5,0	120,0		10,0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	2 802,0	2 800,6	2 801,0	0,0	2 800,6
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>11 974,5</b>	<b>10 809,6</b>	<b>10 138,7</b>	<b>9 998,1</b>	<b>9 907,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0125%	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0126%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	150,0	0,0	4,0
Tasa de interés	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>11 974,5</b>	<b>10 809,6</b>	<b>9 988,7</b>	<b>9 998,1</b>	<b>9 903,2</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	17 215,5	17 014,0	17 162,1	17 042,7	16 874,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,6	18,3	18,5	18,3	18,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	12 325,8	12 543,7	12 399,2	12 213,8	12 059,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,4	13,1	13,3	13,2	13,0
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	750,8	720,3	896,8	936,5	695,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,05/4,00	3,75/4,05/3,99	3,75/4,05/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	80,5	110,0	82,0	54,0	58,0
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	0,5	2,7	84,1	90,5	2,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		2,70 / 3,74			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			33,3 / 3,70	90,5 / 3,65	2,0 / 3,65
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>08 Noviembre</b>	<b>11 Noviembre</b>	<b>12 Noviembre</b>	<b>13 Noviembre</b>	<b>14 Noviembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	138,2	48,8	-112,2	-60,7	-78,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	280,7	-24,0	54,1	-56,6	37,2
a. Mercado spot con el público	119,9	-181,7	-11,0	-155,6	21,5
i. Compras	385,8	184,2	221,7	256,4	320,7
ii. (-) Ventas	265,9	365,9	232,7	412,0	299,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	53,4	88,4	-61,7	-113,6	-180,0
i. Pactadas	157,6	115,2	113,1	113,0	118,4
ii. (-) Vencidas	104,1	26,7	174,8	226,6	298,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	196,0	15,7	104,5	-109,4	-64,8
i. Pactadas	320,6	75,4	136,9	58,8	135,2
ii. (-) Vencidas	124,6	59,7	32,4	168,2	200,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	653,5	313,2	399,8	453,4	491,8
ii. A futuro	35,0	0,0	93,0	27,0	100,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	76,6	43,5	-140,8	-55,8	-82,2
i. Compras	116,0	44,0	10,8	165,6	199,3
ii. (-) Ventas	39,5	0,5	151,6	221,5	281,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	104,8	147,2	63,5	96,5	-0,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datacat)	2,8031	2,8010	2,7985	2,7996	2,7986
(*) Datos preliminares					