

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	18 Noviembre	19 Noviembre	20 Noviembre	21 Noviembre	22 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	14 659,0	13 635,8	12 559,9	11 953,4	11 374,7
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)	50,1	200,0	50,0	50,0	
Propuestas recibidas	391,4	637,6	196,6	218,0	
Plazo de vencimiento	171 d	170 d	533 d	350 d	
Tasas de interés: Mínima	3,58	3,57	3,63	3,59	
Máxima	3,60	3,60	3,70	3,62	
Promedio	3,60	3,60	3,65	3,61	
Saldo	19 563,4	19 763,4	19 813,4	19 863,4	19 863,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Diciembre de 2013		1 621,0			1 621,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 25 y 29 de Noviembre de 2013		0,0			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	5 800,0	4 900,0	4 100,0	3 445,8	2 899,9
Propuestas recibidas	6 720,9	6 259,3	4 858,3	3 445,8	3 167,8
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	3,89	3,90	3,90	3,90	3,89
Máxima	3,96	3,95	3,96	3,97	3,99
Promedio	3,93	3,94	3,94	3,94	3,94
Saldo	5 800,0	4 900,0	4 100,0	3 445,8	2 899,9
Próximo vencimiento de Depósitos el 25 de Noviembre de 2013		4 900,0		3 445,8	2 899,9
Vencimientos de Depósitos entre el 25 y 29 de Noviembre de 2013		4 900,0		3 445,8	2 899,9
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	110,0	140,0		0,0	0,0
Propuestas recibidas	110,0	140,0		0,0	0,0
Plazo de vencimiento	74 d	76 d		75 d	75 d
Tasas de interés: Mínima	0,10	0,14			
Máxima	0,14	0,14			
Promedio	0,11	0,14			
Saldo	2 386,0	2 526,0	2 526,0	2 526,0	2 526,0
Próximo vencimiento de Depósitos Reajustables del BCR el 9 de Diciembre de 2013		250,0			250,0
Vencimientos de Depósitos Reajustables del BCR entre el 25 y 29 de Noviembre de 2013		0,0			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-644,5	-280,3	-546,4	-420,5	-28,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	230,0	100,0	195,0	150,0	10,0
Tipo de cambio promedio	2,8020	2,8025	2,8020	2,8030	2,8028
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	-50,0	-50,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
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	8 054,4	8 115,6	7 863,6	8 037,2	8 446,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%
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	13,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	8 054,4	8 102,6	7 863,6	8 037,2	8 446,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 409,3	16 527,0	16 527,0	16 126,8	15 819,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,6	17,7	17,7	17,3	17,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 912,0	11 711,5	11 474,5	11 125,0	11 003,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,5	12,6	12,6	12,1	11,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	789,5	839,0	967,5	863,0	925,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,05/4,01	4,00/4,10/4,02	4,00/4,05/4,02
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	83,2	107,5	99,5	30,0	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	0,15/0,15/0,15	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	8,0	634,6	1 747,5	508,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		5,0 / 3,60			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	15 Noviembre	18 Noviembre	19 Noviembre	20 Noviembre	21 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	18,4	18,2	-29,8	59,5	-85,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	108,2	121,9	53,5	209,0	14,7
a. Mercado spot con el público	49,4	-113,3	-120,4	7,6	-133,4
i. Compras	266,5	241,6	258,8	267,1	285,7
ii. (-) Ventas	217,2	354,8	379,3	259,4	419,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-39,0	-48,5	-14,4	-25,6	-141,8
i. Pactadas	-43,8	116,1	118,5	132,5	155,9
ii. (-) Vencidas	82,8	164,6	132,9	158,1	297,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	50,8	55,2	68,9	124,0	-42,1
i. Pactadas	118,7	110,6	135,6	202,4	122,9
ii. (-) Vencidas	67,9	55,4	66,6	78,4	165,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	400,0	475,3	498,0	393,5	849,5
ii. A futuro	95,0	123,0	210,0	128,0	110,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-3,5	-130,8	-42,2	-56,4	-110,1
i. Compras	58,5	24,2	66,3	76,8	153,7
ii. (-) Ventas	62,0	155,0	108,5	133,2	263,9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	47,4	256,8	149,9	178,1	125,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7995	2,8010	2,8026	2,8017	2,8026
(*) Datos preliminares					