

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	25 Noviembre	26 Noviembre	27 Noviembre	28 Noviembre	29 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	11 074,3	10 174,2	9 929,9	9 725,1	9 068,0
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		50,0	50,0	
Propuestas recibidas	272,3		174,3	83,1	
Plazo de vencimiento	164 d		526 d	343 d	
Tasas de interés Mínima	3,57		3,57	3,52	
Máxima	3,58		3,61	4,00	
Promedio	3,58		3,61	3,77	
Saldo	19 913,4	19 913,4	19 963,4	20 013,4	20 013,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Diciembre de 2013		1 621,0			1 621,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 2 y el 6 de Diciembre de 2013		0,0	0,0		0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	2 600,0				
Propuestas recibidas	3 203,3				
Plazo de vencimiento	1 d				
Tasas de interés Mínima	3,90				
Máxima	3,98				
Promedio	3,95				
Saldo	2 600,0				
Próximo vencimiento de Depósitos					
Vencimientos de Depósitos entre el 27 y 29 de Noviembre de 2013					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)			150,0		
Propuestas recibidas			150,0		
Plazo de vencimiento			70 d		
Tasas de interés Mínima			0,14		
Máxima			0,14		
Promedio			0,14		
Saldo	2 526,0	2 526,0	2 676,0	2 676,0	2 676,0
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 2 y el 6 de Diciembre de 2013		0,0	0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-448,4	-223,0	-14,0	-14,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	159,9	79,5	5,0	5,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	2,804	2,805	2,8028	2,8026	
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	-50,0
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	50,0
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	7 975,9	9 951,2	9 715,9	9 661,1	9 068,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%	0,0125%
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
Tasa de interés	31,5	346,5	1 195,0	1 642,5	1 196,5
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	7 944,4	9 604,7	8 520,9	8 018,6	9 171,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 346,2	15 309,7	15 270,7	15 150,5	15 109,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,5	16,5	16,4	16,3	16,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 552,5	10 516,1	10 515,5	10 354,9	10 314,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,4	11,3	11,3	11,2	11,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	954,7	1 064,8	1 380,0	1 092,8	915,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,20/4,09	4,15/4,70/4,43	4,00/4,60/4,48	4,50/4,65/4,60	4,50/4,65/4,60
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	541,5	742,5	576,0	638,0	747,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		27,5 / 3,58	29,5 / 3,58		2,0 / 3,63
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	22 Noviembre	25 Noviembre	26 Noviembre	27 Noviembre	28 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-27,6	74,5	-109,7	16,1	16,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-37,8	64,4	-156,2	-64,3	-49,1
a. Mercado spot con el público	-50,7	-72,5	-310,7	-155,0	-59,0
i. Compras	299,4	185,0	245,8	302,1	206,7
ii. (-) Ventas	350,0	257,5	556,5	457,1	265,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	45,3	25,8	-89,4	250,9	98,4
i. Pactadas	152,8	183,4	315,5	387,0	137,5
ii. (-) Vencidas	107,5	157,6	404,9	136,1	39,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	35,0	15,7	-135,9	170,5	33,1
i. Pactadas	93,3	86,5	129,0	246,0	78,4
ii. (-) Vencidas	58,3	70,8	264,9	75,5	45,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	508,0	239,0	886,2	738,4	185,8
ii. A futuro	36,0	15,0	198,0	370,0	30,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-35,4	-76,6	-49,0	-44,1	24,7
i. Compras	57,1	69,2	264,1	70,7	45,1
ii. (-) Ventas	92,5	145,9	313,1	114,9	20,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1,0	126,7	63,5	74,2	-8,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,8023	2,8037	2,8038	2,8011	2,8022
(*) Datos preliminares					