

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	02 Diciembre	03 Diciembre	04 Diciembre	05 Diciembre	06 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 349,2	9 704,3	8 414,8	8 536,0	8 436,7
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)					
Propuestas recibidas	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Plazo de vencimiento	53,0	160,3	160,3	304,8	304,8
Tasas de interés					
Mínima	3,61	3,72	3,72	3,55	3,71
Máxima	4,00	3,72	3,72	3,68	3,68
Promedio	3,72	3,72	3,72	3,63	3,63
Saldo	20 063,4	20 063,4	20 113,4	20 163,4	20 163,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Diciembre de 2013		1 621,0			1 621,0
Vencimientos de CD BCRP entre el 9 y el 13 de Diciembre de 2013		0,0			1 621,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1 000,0	2 200,0	3 500,0	2 000,0	2 200,0
Propuestas recibidas	2 430,0	4 480,0	7 221,0	5 616,0	3 996,0
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés					
Mínima	4,76	4,56	4,81	4,55	4,41
Máxima	4,76	4,81	5,50	4,70	4,65
Promedio	4,76	4,71	5,02	4,63	4,55
Saldo	3 200,0	4 500,0	4 999,9	5 200,0	6 000,0
Próximo vencimiento de Repo el 9 de Diciembre de 2013		3 500,0			5 000,0
Vencimientos de Repo entre el 9 y el 13 de Diciembre de 2013		3 500,0			6 000,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	200,0			220,0	0,0
Propuestas recibidas	230,0			344,0	0,0
Plazo de vencimiento	66 d			67 d	67 d
Tasas de interés					
Mínima	0,10			0,10	Desierta
Máxima	0,14			0,12	
Promedio	0,11			0,10	
Saldo	2 876,0	2 876,0	2 876,0	3 096,0	3 096,0
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 9 y el 13 de Diciembre de 2013		0,0			250,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	-687,0	-1 065,9	-378,5	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	245,0	380,0	135,0		
Tipo de cambio promedio	2,8040	2,8050	2,8040		
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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					
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	11 612,3	12 138,4	11 986,2	12 466,0	13 436,7
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	0,0	356,5	363,5	363,0
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	11 612,3	12 328,4	11 629,7	12 102,5	13 073,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 109,7	15 780,8	15 405,2	16 072,5	16 357,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,3	17,0	16,7	17,5	17,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 313,8	10 985,4	11 033,4	11 365,7	11 650,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,1	11,8	11,6	12,3	12,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	426,0	435,0	217,6	42,1	163,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,70/4,52	4,60/5,50/4,87	4,45/4,60/4,47	4,50/4,50/4,50	4,45/4,70/4,54
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	37,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15		
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	492,0	34,2	170,0	105,0	
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\$)	29 Noviembre	02 Diciembre	03 Diciembre	04 Diciembre	05 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	36,4	-41,1	22,1	-15,1	-52,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-29,7	42,8	139,5	10,8	-99,7
a. Mercado spot con el público	-69,8	-288,2	-321,7	-170,5	-283,6
i. Compras	343,6	238,8	177,4	297,7	355,8
ii. (-) Ventas	413,4	527,0	499,1	468,2	639,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	15,6	252,3	-43,8	49,4	-148,2
i. Pactadas	180,4	385,1	358,9	242,5	202,9
ii. (-) Vencidas	164,7	132,8	402,7	193,1	351,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-49,4	336,2	72,6	75,2	-185,1
i. Pactadas	222,0	508,7	183,7	206,1	139,6
ii. (-) Vencidas	271,4	172,5	111,1	130,9	324,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	651,8	668,2	370,3	546,2	632,7
ii. A futuro	80,0	459,0	96,0	218,0	223,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	158,6	62,3	-235,4	-14,3	104,5
i. Compras	260,9	166,9	110,4	126,6	322,6
ii. (-) Ventas	102,3	104,5	345,8	140,9	218,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-10,9	308,3	403,9	133,3	63,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8007	2,8027	2,8048	2,8038	2,8007
(*) Datos preliminares					