BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	4 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre	9 Setiembre	10 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	10 518,8	10 527,4	10 296,0	10 410,1	12 077,1
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	150,0	226,6		274,1	
Plazo de vencimiento	554 d	371 d		185 d	
Tasas de interés Mínima	4,11	4,06		4,00	
Máxima	4,11	4,06		4,01	
Promedio	4,11	4,06		4,01	
Saldo	23 121,0	23 171,0	23 171,0	23 221,0	21 970,8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Setiembre de 2013					2 378,7
Vencimientos de CD BCRP entre el 11 y 13 de Setiembre de 2013					2 378,7
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	3 000,1	3 000,0	3 000,0	1 415,0	2 000,0
Propuestas recibidas	5 566,0	5 269,0	4 680,0	1 415,0	2 575,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	3 d	3 d	1 d
Tasas de interés Mínima	4,50	4,60	4,50	4,25	4,43
Máxima	4,74	4,75	4,66	4,53	4,51
Promedio	4,68	4,72	4,59	4,36	4,49
Saldo	3 000,1	3 000,0	4 415,0	2 000,0	
Próximo vencimiento de Repo el 11 de Setiembre de 2013					
Vencimientos de Repo entre el 11 y el 13 de Setiembre de 2013					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 602,2	2 602,2	2 602,2	2 602,2	2 344,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables el 24 de Setiembre de 2013					95,0
Vencimientos de CDR BCRP entre el 11 y el 13 de Setiembre de 2013					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	40,0	160,0	0,0	0,0	0,0
2,8080		2,8104			
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 BTF					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTF					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	13 356,6	13 027,7	14 711,0	12 360,1	12 077,1
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%	0,0137%	0,0126%	0,0126%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	225,0	225,0	225,0	220,0	220,0
3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	13 131,6	12 802,7	14 486,0	12 140,1	11 857,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	16 207,7	16 311,8	16 881,1	17 158,9	16 959,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,7	17,9	18,6	18,9	18,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 546,0	11 942,4	12 114,5	12 509,7	12 444,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,8	13,0	13,6	13,9	13,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	250,0	229,0	225,5	351,5	337,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,40/4,70/4,60	4,65/4,70/4,70	4,25/4,70/4,51	4,20/4,25/4,25	4,25/4,35/4,28
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	41,0	74,0	89,9	101,9
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	349,7	211,6	54,5	50,4	1 193,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					39,7 / 4,00
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			50,0 / 4,05		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	03 Setiembre	04 Setiembre	05 Setiembre	06 Setiembre	09 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	35,0	4,4	86,6	-68,9	-27,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-35,3	-92,1	272,3	-115,6	-175,3
a. Mercado spot con el público	-137,2	-195,4	-10,8	-220,4	-183,2
i. Compras	258,9	204,2	264,5	195,1	240,5
ii. (-) Ventas	396,1	399,6	275,2	415,5	423,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-10,2	79,1	-212,9	76,2	24,3
i. Pactadas	140,2	190,9	74,0	226,3	188,9
ii. (-) Vencidas	150,4	111,8	287,0	150,1	164,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-80,6	-17,5	-27,3	29,5	-124,0
i. Pactadas	156,9	106,9	71,0	65,1	138,8
ii. (-) Vencidas	237,4	124,4	98,3	35,6	262,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	436,8	455,8	374,0	391,9	532,8
ii. A futuro	178,0	72,0	110,0	92,0	120,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	58,9	75,6	-73,4	-6,9	106,1
i. Compras	153,9	121,8	97,2	24,6	190,2
ii. (-) Ventas	94,9	46,2	170,6	31,5	84,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	130,0	40,3	167,7	-2,9	-0,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8096	2,8075	2,8101	2,8042	2,7968
(*) Datos preliminares					

d. = día(s) s. = semana(s) m. = mes(es) a. = año(s)