

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	3 Setiembre	4 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	14 162.5	14 409.6	14 177.4	15 532.3	15 615.7
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	100.0	50.0	100.0
Plazo de vencimiento		278.4	388.7	198.3	153.8
Tasas de interés		189 d	372 d	1 a.	1 a.
Mínima		4.00	4.04	4.00	4.02
Máxima		4.05	4.04	4.03	4.20
Promedio		4.02	4.04	4.02	4.10
Saldo	19 231.0	19 281.0	19 381.0	19 531.0	19 531.0
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de setiembre de 2012)					1 500.1
Vencimientos de CD BCRP del 10 al 14 de setiembre de 2012					2 970.1
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					5 300.0
Propuestas recibidas			2 500.0	4 400.0	7 125.8
Plazo de vencimiento			4 836.0	6 537.0	7 125.8
Tasas de interés			1 d	1 d	3 d
Mínima			3.80	4.10	4.05
Máxima			4.15	4.18	4.20
Promedio			4.13	4.14	4.15
Saldo			2 500.0	4 400.0	5 300.0
Próximo vencimiento de Depósitos (10 de setiembre de 2012)					5 300.0
Vencimientos de Depósitos del 10 al 14 de setiembre de 2012					5 300.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	260.8	208.7	156.7	156.6	156.5
i. Compras (millones de US\$)	100.0	80.0	60.0	60.0	60.0
Tipo de cambio promedio	2.6078	2.6090	2.6119	2.6103	2.6090
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
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					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	14 423.3	14 568.3	11 734.1	11 138.9	10 472.3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0135%	0.0135%	0.0135%	0.0135%	0.0135%
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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	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	14 423.3	14 568.3	11 734.1	11 138.9	10 472.3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 196.9	15 196.9	15 196.9	15 196.9	14 287.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	19.9	19.9	18.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 818.5	9 027.6	10 412.8	10 877.0	10 647.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15.4	15.4	15.4	15.4	13.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	402.0	559.0	744.5	513.0	814.4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,24	4,18/4,25/4,22	4,15/4,25/4,22	4,10/4,25/4,20	4,20/4,25/4,21
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	17.9	14.1	83.1	51.1	63.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,00/1,00	1,20/1,20/1,20	1,20/1,25/1,21	1,70/1,70/1,70	2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	12.0	18.0	49.0	17.9	67.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		11,0 / 4,00	9,0 / 4,05		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				9,0 / 4,03	40,0 / 4,05
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 Agosto	03 Setiembre	04 Setiembre	05 Setiembre	06 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	148.8	-123.3	-121.3	231.5	-85.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	112.5	-162.2	-155.3	110.0	96.0
a. Mercado spot con el público	97.3	-40.8	-64.2	147.6	154.6
i. Compras	175.5	247.2	289.3	355.8	337.3
ii. (-) Ventas	78.2	288.0	353.5	208.2	182.7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-33.0	11.8	-9.1	187.7	-58.3
i. Pactadas	11.5	30.7	36.2	230.2	117.2
ii. (-) Vencidas	44.5	18.9	45.3	42.4	175.5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	131.9	131.9	131.9	131.9	131.9
i. Pactadas	0.1	0.1	136.1	166.1	164.5
ii. (-) Vencidas	70.3	27.2	179.2	99.9	41.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0.0	825.8	919.6	1241.0	1306.0
ii. A futuro	0.0	156.0	275.0	400.0	195.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	41.0	-12.5	123.4	79.9	-132.7
i. Compras	66.1	0.6	160.9	91.0	40.8
ii. (-) Ventas	25.1	13.1	37.6	11.2	173.5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0.0	-100.7	-80.5	-60.0	-60.0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	--	2.6075	2.6082	2.6116	2.6102
(*) Datos preliminares					