

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

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

	17 Setiembre	18 Setiembre	19 Setiembre	20 Setiembre	21 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	17 780.1	18 100.5	17 437.9	17 159.1	16 827.5
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	128.6	50.0 150.1	200.0	50.0 150.0 50.0	150.0 50.0
Plazo de vencimiento	484.6	408.6 777.3	619.0	291.2 459.5 283.4	693.5 260.5
Tasas de interés	360 d	175 d 359 d	358 d	357 d 357 d 539 d	356 d 538 d
Mínima	3.96	3.94 3.95	3.95	3.95 3.96 4.00	3.98 4.00
Máxima	4.16	3.94 4.00	3.99	3.99 3.99 4.10	4.00 4.05
Promedio	4.01	3.94 3.97	3.99	3.97 3.98 4.09	4.00 4.05
Saldo	17 489.5	17 689.6	17 889.6	18 139.6	18 339.6
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de octubre de 2012)					750.0
Vencimientos de CD BCRP del 24 al 28 de setiembre de 2012					0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 000.0 5 000.0	4 000.3 5 599.7	4 000.1 5 000.0	4 000.1 4 400.2	3 999.8 4 200.1
Propuestas recibidas	6 932.0 7 204.0	9 201.4 7 713.0	8 988.5 6 722.8	8 197.4 5 908.4	9 130.0 5 368.7
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés	4.22 4.19	4.22 4.19	4.21 4.19	4.22 4.18	4.20 4.18
Mínima	4.24 4.24	4.23 4.23	4.23 4.23	4.23 4.23	4.22 4.22
Máxima	4.23 4.23	4.23 4.22	4.22 4.22	4.22 4.22	4.22 4.21
Promedio	4.23 4.23	4.23 4.22	4.22 4.22	4.22 4.22	4.22 4.21
Saldo	9 000.0	9 600.0	9 000.1	8 400.3	8 199.9
Próximo vencimiento de Depósitos (24 de setiembre de 2012)					8 199.9
Vencimientos de Depósitos del 24 al 28 de setiembre de 2012					8 199.9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	104.1	104.1	104.1	52.1	52.0
i. Compras (millones de US\$)	40.0	40.0	40.0	20.0	20.0
Tipo de cambio promedio	2.6023	2.6026	2.6020	2.6030	2.6005
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	8 755.6	8 404.5	8 341.9	8 560.9	8 479.6
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	8 755.6	8 404.5	8 341.9	8 560.9	8 479.6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 196.9	15 196.9	15 196.9	15 196.9	13 347.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	19.9	19.9	17.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 143.9	9 933.7	9 848.7	9 769.4	9 708.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15.4	15.4	15.4	15.4	12.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	338.0	468.0	566.0	624.0	519.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,23	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	148.4	233.7	282.7	132.7	189.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,20/1,25/1,24	1,15/1,25/1,23	1,10/1,25/1,23	1,20/1,25/1,24	1,00/1,25/1,22
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	60.0	53.0	100.0	66.9	90.4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			50.0 / 3,94		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	60.0 / 3,98	40.0 / 3,97	50.0 / 3,96	17.0 / 3,96	50.0 / 3,95
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	14 Setiembre	17 Setiembre	18 Setiembre	19 Setiembre	20 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	4.9	144.8	16.4	-27.3	175.5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	38.4	26.7	94.9	127.9	66.1
a. Mercado spot con el público	127.3	54.4	174.0	112.6	45.3
i. Compras	412.5	313.2	371.2	373.8	337.1
ii. (-) Ventas	285.1	258.7	197.2	261.2	291.7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	27.3	183.2	-115.0	-45.3	-39.7
i. Pactadas	113.2	288.7	122.3	174.4	170.7
ii. (-) Vencidas	85.9	105.5	237.3	219.8	210.4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	60.8	65.2	-36.5	109.9	-149.1
i. Pactadas	117.3	102.1	73.9	186.4	118.0
ii. (-) Vencidas	56.5	37.0	110.5	76.5	267.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	783.2	854.5	768.2	1156.5	792.9
ii. A futuro	215.0	203.0	262.0	265.0	188.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-33.4	-65.2	-155.9	-97.9	99.2
i. Compras	27.6	33.9	58.2	65.5	262.4
ii. (-) Ventas	60.9	99.1	214.1	163.5	163.2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-85.0	-31.0	-50.1	-30.0	-21.7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.5961	2.6009	2.6020	2.6016	2.6029
(*) Datos preliminares					