BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	12 Noviembre	13 Noviembre	14 Noviembre	15 Noviembre	16 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**19 838,9**	**19 774,8**	**19 519,8**	**19 481,8**	**19 392,4**
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)	100,0	50,0 100,0	100,0	50,0 100,0	100,0 100,0
Propuestas recibidas	389,5	436,5 486,5	420,8	293,0 311,0	186,0 222,8
Plazo de vencimiento	360 d	175 d 175 d	358 d	357 d 539 d	356 d 538 d
Tasas de interés Mínima	3,96	3,82 3,84	3,95	3,85 3,94	3,94 4,00
Máxima	4,02	3,85 3,85	4,02	3,95 4,00	4,05 4,05
Promedio	4,00	3,85 3,85	3,99	3,91 4,00	4,00 4,04
Saldo	20 710,0	20 860,0	20 960,0	21 110,0	21 310,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (27 de noviembre de 2012)					220,0
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 23 de noviembre de 2012					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	5 799,9	6 700,0	7 199,9	7 600,3	7 599,9
Propuestas recibidas	11 038,6	10 758,2	9 590,5	10 356,2	9 799,7
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,11	4,10	4,10	4,10	4,08
Máxima	4,17	4,15	4,15	4,15	4,15
Promedio	4,14	4,13	4,13	4,13	4,12
Saldo	5 799,9	6 700,0	7 199,9	7 600,3	7 599,9
Próximo vencimiento de Depósitos (19 de noviembre de 2012)					7 599,9
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 23 de noviembre de 2012					7 599,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	26,1	26,1	26,1	26,0	26,1
i. Compras (millones de US$)	10,0	10,0	10,0	10,0	10,0
Tipo de cambio promedio	2,6142	2,6115	2,6050	2,6040	2,6080
ii. Ventas (millones de US$)					
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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**13 965,1**	**12 950,9**	**12 246,0**	**11 757,5**	**11 668,6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0134%	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0135%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**13 965,1**	**12 950,9**	**12 246,0**	**11 757,5**	**11 668,6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 296,7	13 296,7	13 296,7	13 296,7	17 404,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	16,9	16,9	16,9	21,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	13 929,1	14 162,1	14 068,9	13 938,7	13 796,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,3	12,3	12,3	12,3	16,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	613,2	705,1	602,5	556,5	703,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,24	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	28,7	52,5	100,8	120,0	112,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,25/5,40/4,99	5,00/5,50/5,10	5,00/5,50/5,24	4,75/5,50/5,03	4,1/5,05/4,90
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	870,6	746,1	681,9	411,0	1 907,9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			21,5 / 3,86	41,0 / 3,85	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				20,0 / 4,00	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**9 Noviembre**	**12 Noviembre**	**13 Noviembre**	**14 Noviembre**	**15 Noviembre**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	**-69,7**	**-20,0**	**-60,6**	**61,0**	**-33,5**
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	**107,7**	**9,2**	**55,4**	**154,6**	**-36,2**
a. Mercado spot con el público	**35,0**	**-4,5**	**65,2**	**167,0**	**-1,3**
i. Compras	456,9	358,1	383,9	374,0	294,1
ii. (-) Ventas	421,9	362,6	318,7	207,0	295,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	**2,7**	**56,1**	**-136,2**	**22,9**	**-33,7**
i. Pactadas	315,3	194,5	19,0	274,5	124,8
ii. (-) Vencidas	312,7	138,4	155,2	251,7	158,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	**180,1**	**85,3**	**-20,2**	**116,4**	**-36,4**
i. Pactadas	273,2	100,1	87,6	280,0	328,8
ii. (-) Vencidas	93,1	14,8	107,7	163,6	365,2
d.. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	851,0	846,0	1414,6	675,4	873,0
ii. A futuro	120,0	109,0	114,9	178,0	176,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	**-118,6**	**-99,9**	**-42,2**	**-93,0**	**189,8**
i. Compras	75,4	1,1	107,0	117,6	337,6
ii. (-) Ventas	194,0	101,0	149,3	210,7	147,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	**-28,2**	**-10,0**	**-15,0**	**-7,5**	**-18,0**
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6120	2,6126	2,6152	2,6049	2,6026
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera