

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	24 Setiembre	25 Setiembre	26 Setiembre	27 Setiembre	28 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones	16 075.0	16 566.6	16 469.7	16 649.8	16 764.6
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)	<u>150.0</u> <u>50.0</u>	<u>50.0</u> <u>150.0</u> <u>100.0</u>	<u>200.0</u> <u>100.0</u>	<u>50.0</u> <u>200.0</u> <u>100.0</u>	<u>100.0</u> <u>100.0</u>
Propuestas recibidas	655,8 215,8	342,5 297,0 378,0	778,2 394,9	303,3 681,8 434,6	320,0 243,9
Plazo de vencimiento	353 d 535 d	168 d 352 d 534 d	351 d 533 d	350 d 287 d 532 d	286 d 531 d
Tasas de interés:	3,96 4,00	3,90 3,95 4,01	3,94 4,00	3,90 3,85 3,99	3,93 3,98
	3,98 4,04	3,90 3,95 4,01	3,97 4,03	3,91 3,95 4,00	3,95 4,02
	3,98 4,02	3,90 3,95 4,01	3,96 4,02	3,91 3,92 3,99	3,93 4,00
Saldo	<u>18 539.6</u>	<u>18 839.6</u>	<u>19 139.6</u>	<u>19 489.6</u>	<u>19 689.6</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de octubre de 2012)					750,0
Vencimientos de CD BCRP del 3 al 5 de octubre de 2012					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	<u>4 000.0</u> <u>2 499.9</u>	<u>4 000.1</u> <u>2 599.9</u>	<u>4 000.0</u> <u>2 399.9</u>	<u>3 000.1</u> <u>3 899.8</u>	<u>3 000.1</u> <u>2 769.3</u>
Propuestas recibidas	5 934,0 3 952,5	6 360,0 3 798,9	4 958,0 2 399,9	5 490,0 4 922,0	4 468,0 2 769,3
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	5 d 5 d
Tasas de interés:	4,18 4,18	4,20 4,18	4,21 4,18	4,21 4,18	4,20 4,15
	4,23 4,21	4,22 4,22	4,22 4,22	4,22 4,22	4,22 4,22
	4,22 4,19	4,21 4,20	4,22 4,20	4,21 4,20	4,21 4,17
Saldo	<u>6 499.9</u>	<u>6 600.0</u>	<u>6 399.9</u>	<u>6 899.9</u>	<u>6 769.4</u>
Próximo vencimiento de Depósitos (3 de octubre de 2012)				6 899,0	5 769,4
Vencimientos de Depósitos del 3 al 5 de octubre de 2012				6 899,9	5 769,4
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	259,7	155,8	311,4	259,5	103,9
i. Compras (millones de US\$)	100,0	60,0	120,0	100,0	40,0
Tipo de cambio promedio	2.5967	2.5962	2.5950	2.5946	2.5978
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	7,8	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	7,8				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR	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	9 634.8	9 822.4	10 081.2	9 659.3	10 899.1
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	732,0
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	9 634.8	9 822.4	10 081.2	9 659.3	10 167.1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de US\$)	15 196,9	13 296,7	13 296,7	13 296,7	13 250,8
b. Fondos de encaje en moneda extranjera promedio acumulado (% del TC)	19,9	16,9	16,9	16,9	16,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de US\$)	9 650,4	9 560,7	9 571,2	9 590,8	9 611,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TC)	15,4	12,3	12,3	12,3	12,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	741,5	1 135,0	830,0	903,3	656,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,20/4,30/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	237,5	227,5	348,5	342,7	22,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,85/0,90/0,89	0,85/0,90/0,89	0,85/0,95/0,90	0,85/0,90/0,89	0,90/0,90/0,90
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	95,0	139,0	1 073,1	1 161,5	992,9
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			50,0 / 3,90		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		50,0 / 3,95			48,9 / 3,91
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Setiembre	24 Setiembre	25 Setiembre	26 Setiembre	27 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-62,5	-79,0	49,4	-32,0	-107,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-8,8	-23,6	-6,3	21,3	-104,5
a. Mercado spot con el público	23,0	80,0	60,0	149,5	-7,7
i. Compras	374,2	297,5	312,7	396,5	353,2
ii. (-) Ventas	351,2	217,5	252,7	247,0	360,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	40,9	-36,3	109,3	-170,8	34,0
i. Pactadas	91,4	15,7	192,7	37,5	135,9
ii. (-) Vencidas	50,5	52,0	83,4	208,3	101,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	94,5	19,0	53,6	-117,5	37,1
i. Pactadas	133,0	128,3	169,2	161,9	79,3
ii. (-) Vencidas	38,4	109,4	115,6	279,4	42,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	580,4	554,5	904,2	1034,3	1080,9
ii. A futuro	138,0	235,0	250,0	193,0	170,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards	-20,1	59,8	32,3	77,0	-53,1
i. Compras	23,7	107,4	114,0	275,4	39,6
ii. (-) Ventas	43,8	47,6	81,7	198,3	92,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-23,8	-106,1	-66,5	-134,2	-103,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.5997	2.5973	2.5956	2.5959	2.5936
(*) Datos preliminares					