

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	27 Agosto	28 Agosto	29 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	14 169.7	14 581.0	14 941.5
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	100.0	50.0 100.0	
Plazo de vencimiento	203.6	246.0 363.0	
Tasas de interés Mínima	9 m.	6 m. 9 m.	
Máxima	4.06	4.00 4.00	
Promedio	4.09	4.09 4.09	
Saldo	4.09	4.05 4.08	
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de setiembre de 2012)	<u>19 481.0</u>	<u>19 231.0</u>	<u>19 231.0</u>
Vencimientos de CD BCRP del 3 al 7 de setiembre de 2012			1 500.1
			0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	<u>7 200.0</u>	<u>8 000.0</u>	<u>8 100.0</u>
Propuestas recibidas	9 002.3	10 650.5	8 522.0
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	5 d.
Tasas de interés Mínima	4.07	4.14	4.00
Máxima	4.23	4.21	4.18
Promedio	4.20	4.19	4.15
Saldo	<u>7 200.0</u>	<u>8 000.0</u>	<u>8 100.0</u>
Próximo vencimiento de Depósitos (3 de setiembre de 2012)			8 100.0
Vencimientos de Depósitos del 3 al 7 de setiembre de 2012			8 100.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>41.8</u>	<u>240.1</u>	<u>412.4</u>
i. Compras (millones de US\$)	16.0	92.0	158.0
Tipo de cambio promedio	2.6110	2.6100	2.6100
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>
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	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>	<u>0.0</u>
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	6 911.5	6 671.1	7 253.9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0135%	0.0135%	0.0135%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>			
Tasa de interés	5.05%	5.05%	5.05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>			
Tasa de interés	5.05%	5.05%	5.05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>125.0</u>	<u>450.0</u>	<u>924.0</u>
Tasa de interés	3.45%	3.45%	3.45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	6 786.5	6 221.1	6 329.9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 196.9	15 196.9	12 702.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	16.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 457.6	9 194.1	9 095.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15.4	15.4	11.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>466.7</u>	<u>389.6</u>	<u>430.0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,25
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>134.8</u>	<u>263.6</u>	<u>14.9</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,25/0,25/0,25	0,25/0,25/0,25	0,25/0,25/0,25
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	<u>122.0</u>	<u>37.0</u>	<u>71.0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			25,0 / 4,03
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	50,0 / 4,07		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	24 Agosto	27 Agosto	28 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-18.2	-188.9	17.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	29.7	-91.7	-31.1
a. <u> Mercado spot con el público</u>	<u>26.7</u>	<u>-78.1</u>	<u>101.9</u>
i. Compras	337.3	283.2	350.2
ii. (-) Ventas	310.7	361.3	248.3
b. <u> Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-9.8</u>	<u>-14.2</u>	<u>-170.4</u>
i. Pactadas	76.4	86.9	104.3
ii. (-) Vencidas	86.3	101.2	274.7
c. <u> Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>131.9</u>	<u>131.9</u>	<u>131.9</u>
i. Pactadas	47.2	202.9	125.2
ii. (-) Vencidas	9.2	119.9	344.5
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>			
i. Al contado	406.3	614.8	949.7
ii. A futuro	160.0	226.0	245.0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-74.0</u>	<u>21.2</u>	<u>72.7</u>
i. Compras	0.2	116.5	340.9
ii. (-) Ventas	74.2	95.3	268.2
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>-0.1</u>	<u>-16.0</u>	<u>-135.9</u>
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.6133	2.6113	2.6104
(*) Datos preliminares			