

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	3 Octubre	4 Octubre	5 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	15 600,1	15 835,0	15 741,5
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)		50,0 100,0 100,0	100,0 100,0
Propuestas recibidas		298,0	296,9
Plazo de vencimiento		371 d	371 d
Tasas de interés Mínima		3,91	3,92
Máxima		3,93	3,92
Promedio		3,92	3,99
Saldo	19 689,6	19 939,6	20 139,6
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de octubre de 2012)			750,0
Vencimientos de CD BCRP del 9 al 12 de octubre de 2012			750,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			1 000,0
Propuestas recibidas			4 588,1
Plazo de vencimiento			4 d
Tasas de interés Mínima			4,00
Máxima			4,15
Promedio			4,13
Saldo			1 000,0
Próximo vencimiento de Depósitos (9 de octubre de 2012)			1 000,0
Vencimientos de Depósitos del 9 al 12 de octubre de 2012			1 000,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	52,0	51,9	51,9
Tipo de cambio promedio	20,0	20,0	20,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,5988	2,5963	2,5938
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	15 652,0	15 637,0	14 593,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)			
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0135%	0,0135%	0,0140%
Tasa de interés			
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	5,05%	5,05%	5,05%
Tasa de interés			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5,05%	5,05%	5,05%
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0
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	15 652,0	15 637,0	14 593,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 296,7	13 296,7	16 036,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	16,9	20,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 650,7	11 995,4	12 515,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,3	12,3	15,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	406,0	611,0	890,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,26	4,15/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	21,0	68,0	95,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,90/0,90/0,90	1,00/1,10/1,08	1,00/1,10/1,01
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	1 066,0	1 085,7	1 169,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			20,0 / 3,90
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Setiembre	03 Octubre	04 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	271,3	-165,5	11,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	251,4	-191,2	-51,6
a. Mercado spot con el público	208,3	-162,8	-43,5
i. Compras	627,2	290,6	357,1
ii. (-) Ventas	419,0	453,4	400,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-48,1	46,6	-20,2
i. Pactadas	162,4	177,8	72,6
ii. (-) Vencidas	210,5	131,1	92,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-67,9	20,9	-83,6
i. Pactadas	247,9	135,9	105,9
ii. (-) Vencidas	315,8	114,9	189,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	1166,8	891,5	886,5
ii. A futuro	285,0	228,0	185,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	179,1	-24,2	108,6
i. Compras	309,5	98,8	184,4
ii. (-) Ventas	130,4	123,1	75,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-30,7	-20,4	-20,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5980	2,5982	2,5959
(*) Datos preliminares			