

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	9 Octubre			10 Octubre		11 Octubre			12 Octubre	
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>17,055.1</b>			<b>17,385.2</b>		<b>18,228.8</b>			<b>18,112.9</b>	
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>										
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR										
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)	50.0 100.0 100.0			200.0 150.0		50.0 200.0 200.0			300.0 250.0	
Propuestas recibidas	472.0	561.3	323.7	744.0	443.0	401.4	821.5	439.0	1 091.6	651.5
Plazo de vencimiento	182 d	366 d	548 d	365 d	547 d	364 d	364 d	546 d	363 d	545 d
Tasas de interés	3.85	3.88	3.93	3.89	3.94	3.89	3.88	3.92	3.86	3.93
Mínima	3.85	3.90	3.96	3.90	3.95	3.89	3.89	3.94	3.90	3.96
Máxima	3.85	3.90	3.96	3.89	3.95	3.89	3.89	3.94	3.89	3.96
Promedio	3.85	3.90	3.96	3.89	3.95	3.89	3.89	3.94	3.89	3.96
Saldo	19,639.6			19,989.6		19,259.6			19,809.6	
Próximo vencimiento de CD BCRP (18 de octubre de 2012)									300.0	
Vencimientos de CD BCRP del 15 al 19 de octubre de 2012									300.0	
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	2,999.9			5,200.0		6,800.1			7,600.0	
Propuestas recibidas	8,099.7			9,666.0		10,588.1			10,979.0	
Plazo de vencimiento	1 d			1 d		1 d			3 d	
Tasas de interés	4.00			4.04		4.00			3.95	
Mínima	4.15			4.14		4.12			4.11	
Máxima	4.12			4.09		4.09			4.08	
Promedio	4.12			4.09		4.09			4.08	
Saldo	2,999.9			5,200.0		6,800.1			7,600.0	
Próximo vencimiento de Depósitos (15 de octubre de 2012)									7,600.0	
Vencimientos de Depósitos del 15 al 19 de octubre de 2012									7,600.0	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	103.5			206.8		206.9			206.9	
i. Compras (millones de US\$)	40.0			80.0		80.0			80.0	
Tipo de cambio promedio	2.5871			2.5866		2.5864			2.5863	
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	
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	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP										
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>13,908.7</b>			<b>12,042.0</b>		<b>11,185.6</b>			<b>10,169.8</b>	
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps), Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0136%			0.0136%		0.0136%			0.0136%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	5.05%			5.05%		5.05%			5.05%	
Tasa de interés	5.05%			5.05%		5.05%			5.05%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	0.0			0.0		0.0			1,000.0	
Tasa de interés	3.45%			3.45%		3.45%			3.45%	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0			0.0		0.0			1,000.0	
Tasa de interés	3.45%			3.45%		3.45%			3.45%	
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>13,908.7</b>			<b>12,042.0</b>		<b>11,185.6</b>			<b>9,169.8</b>	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13,296.7			13,296.7		13,296.7			16,747.3	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16.9			16.9		16.9			21.0	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	13,243.3			13,767.2		13,594.7			13,226.0	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12.3			12.3		12.3			16.6	
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	826.0			642.0		547.0			611.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.25/4.25/4.25			4.20/4.25/4.25		4.25/4.25/4.25			4.00/4.25/4.22	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	310.6			166.3		192.4			199.2	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1.00/1.00/1.00			0.80/1.00/0.96		0.95/1.00/0.99			1.00/1.00/1.00	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	1,384.0			1,340.0		822.0			722.0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)						60.0 / 3.89			30.0 / 3.89	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)										
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>05 Octubre</b>			<b>09 Octubre</b>		<b>10 Octubre</b>			<b>11 Octubre</b>	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	15.9			-74.0		71.2			33.4	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-27.5			-89.7		100.9			-62.0	
a. Mercado spot con el público	7.8			-40.6		187.1			-14.5	
i. Compras	315.7			226.7		410.2			297.0	
ii. (-) Ventas	307.8			267.3		223.1			311.4	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	24.9			-55.9		-18.9			-66.4	
i. Pactadas	76.4			102.2		261.7			226.6	
ii. (-) Vencidas	51.5			158.0		280.6			292.9	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-18.5			-71.5		10.7			-161.7	
i. Pactadas	56.2			72.9		87.2			18.4	
ii. (-) Vencidas	74.7			144.5		76.5			180.1	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	1105.7			763.0		1222.2			950.9	
ii. A futuro	278.0			175.0		265.0			73.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	20.9			-20.7		-210.1			-88.2	
i. Compras	63.0			124.7		66.1			169.8	
ii. (-) Ventas	42.1			145.4		276.3			258.0	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-33.0			-42.0		-80.2			-72.1	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.5932			2.5866		2.5849			2.5854	
(*) Datos preliminares										