

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	22 Octubre	23 Octubre	24 Octubre	25 Octubre	26 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	17 330,5	17 572,8	17 623,9	17 828,7	18 172,8
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	150,0	50,0		50,0 100,0	100,0
Plazo de vencimiento	336,5	305,3		263,5 142,9	398,1
Tasas de interés	3,97	3,88		3,92 3,91	3,95
Mínima	4,01	3,93		3,92 4,05	3,95
Máxima	4,00	3,89		3,92 4,01	3,95
Promedio	21 250,0	21 300,0	21 300,0	21 450,0	21 550,0
Saldo					1 550,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (6 de noviembre de 2012)					0,0
Vencimientos de CD BCRP del 29 al 31 de octubre de 2012					9 099,9
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	8 500,1	8 449,9	8 699,9	8 700,0	9 099,9
Propuestas recibidas	9 582,6	9 006,7	9 270,1	10 438,9	10 544,3
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés	4,05	4,12	4,15	4,17	4,11
Mínima	4,25	4,25	4,25	4,25	4,25
Máxima	4,19	4,22	4,23	4,23	4,21
Promedio	8 500,1	8 449,9	8 699,9	8 700,0	9 099,9
Saldo	8 500,1	8 449,9			9 099,9
Próximo vencimiento de Depósitos (29 de octubre de 2012)	8 500,1	8 449,9			9 099,9
Vencimientos de Depósitos del 29 al 31 de octubre de 2012	8 500,1	8 449,9			9 099,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	257,9	206,6	155,0	103,5	52,1
i. Compras (millones de US\$)	100,0	80,0	60,0	40,0	20,0
Tipo de cambio promedio	2,5787	2,5819	2,5833	2,5885	2,6047
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	8 938,3	9 279,5	9 079,0	9 082,3	9 025,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%	0,0136%	0,0136%	0,0136%	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	8 938,3	9 279,5	9 079,0	9 082,3	9 075,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 296,7	13 296,7	13 296,7	13 296,7	14 447,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	16,9	16,9	16,9	18,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 469,3	11 172,0	11 089,7	11 005,9	10 927,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,3	12,3	12,3	12,3	13,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	383,1	502,5	329,0	365,5	462,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,25/4,24	4,10/4,25/4,23	4,20/4,25/4,25	4,00/4,25/4,22	4,00/4,25/4,21
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	99,7	139,7	105,6	73,4	160,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,95/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,10/1,40/1,21	1,10/2,00/1,80	2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP-NR y CDV	878,0	887,2	880,0	800,0	700,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		17,2 / 3,91			2,0 / 4,20
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			30,0 / 3,88		50,0 / 3,89
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	19 Octubre	22 Octubre	23 Octubre	24 Octubre	25 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	148,9	-137,2	9,3	-14,0	105,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	60,2	-166,5	-30,6	16,2	90,4
a. Mercado spot con el público	207,1	-60,7	53,9	63,7	134,8
i. Compras	465,9	266,9	302,2	309,2	305,9
ii. (-) Ventas	258,8	334,9	248,3	245,5	171,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	49,7	12,5	30,2	167,6	57,3
i. Pactadas	179,1	142,8	143,8	197,4	203,1
ii. (-) Vencidas	129,5	130,2	113,6	29,8	145,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-39,1	-16,8	-9,7	197,8	42,6
i. Pactadas	25,5	52,8	110,7	238,7	189,3
ii. (-) Vencidas	64,5	69,6	120,4	40,8	146,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1347,9	798,8	960,4	820,8	1158,3
ii. A futuro	196,0	156,0	235,0	191,0	128,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-58,0	-42,6	5,9	14,3	-2,7
i. Compras	64,3	53,1	117,2	39,8	137,4
ii. (-) Ventas	122,2	95,7	111,3	25,5	140,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-153,9	-116,6	-83,5	-50,7	-40,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5795	2,5777	2,5812	2,5820	2,5860
(*) Datos preliminares					