BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	5 Noviembre	6 Noviembre	7 Noviembre	8 Noviembre	9 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**17 364,8**	**19 645,7**	**19 456,7**	**19 540,5**	**19 856,9**
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	50,0 100,0	200,0
Propuestas recibidas		313,9 435,0 392,8	303,3	271,5 301,2	411,0
Plazo de vencimiento		182 d 182 d 366 d	365 d	364 d 364 d	95 d
Tasas de interés Mínima		3,79 3,81 3,80	3,92	3,94 3,94	3,81
Máxima		3,91 3,85 3,96	4,00	3,96 4,00	4,10
Promedio		3,81 3,84 3,89	3,97	3,96 3,96	4,04
Saldo	21 700,0	20 400,0	20 500,0	20 410,0	20 610,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (27 de noviembre de 2012)					220,0
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de noviembre de 2012					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 000,0	3 099,8	2 900,2	3 600,0	4 400,0
Propuestas recibidas	3 636,0	6 420,7	7 516,8	9 453,7	10 691,5
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	3,90	4,10	4,05	4,10	4,09
Máxima	4,22	4,20	4,19	4,18	4,17
Promedio	4,19	4,18	4,18	4,17	4,15
Saldo	1 000,0	3 099,8	2 900,2	3 600,0	4 400,0
Próximo vencimiento de Depósitos (12 de noviembre de 2012)		3 099,8			4 400,0
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de noviembre de 2012		3 099,8			4 400,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	52,2	52,0	52,1	52,2	52,2
i. Compras (millones de US$)	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0
Tipo de cambio promedio	2,6092	2,6018	2,6069	2,6079	2,6120
ii. Ventas (millones de US$)					
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$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**16 417,0**	**16 348,0**	**16 508,6**	**15 842,7**	**15 309,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0134%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**16 417,0**	**16 348,0**	**16 508,6**	**15 842,7**	**15 309,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 296,7	13 296,7	13 296,7	13 296,7	17 271,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	16,9	16,9	16,9	21,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 234,1	4 493,6	12 950,2	13 458,6	13 664,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,3	12,3	12,3	12,3	16,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	443,0	444,0	1 001,2	1 042,2	943,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	15,0	32,0	37,6	4,5	22,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,50/2,50/2,50	3,00/3,50/3,13	3,50/3,70/3,55	3,80/3,80/3,80	5,00/5,80/5,53
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	850,0	770,0	1 083,7	862,0	918,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			40,2 / 3,86		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			43,5/ 3,95		83,1 / 3,95
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**2 Noviembre**	**5 Noviembre**	**6 Noviembre**	**7 Noviembre**	**8 Noviembre**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	**-31,1**	**161,9**	**27,9**	**67,9**	**7,1**
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	**-29,3**	**109,2**	**8,0**	**147,7**	**75,7**
a. Mercado spot con el público	**-44,1**	**134,7**	**27,5**	**147,3**	**91,8**
i. Compras	83,8	405,8	342,9	523,3	311,5
ii. (-) Ventas	127,9	271,1	315,4	376,0	219,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	**-33,0**	**85,5**	**179,8**	**0,5**	**-30,9**
i. Pactadas	3,2	310,8	256,8	183,4	133,9
ii. (-) Vencidas	36,1	225,3	77,0	182,9	164,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	**-31,2**	**32,9**	**159,9**	**80,2**	**37,7**
i. Pactadas	0,0	71,2	241,7	237,1	347,7
ii. (-) Vencidas	31,2	38,4	81,7	156,9	310,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0,0	1250,5	1414,0	1262,0	1079,0
ii. A futuro	0,0	128,0	210,0	158,0	144,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	**9,9**	**-188,2**	**5,4**	**-13,6**	**144,2**
i. Compras	31,0	2,6	57,9	154,2	298,6
ii. (-) Ventas	21,1	190,8	52,5	167,8	154,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	**0,0**	**-24,1**	**-20,2**	**-12,1**	**-15,1**
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	-.-	2,6047	2,6071	2,6036	2,6058
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera