

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	5 Diciembre	6 Diciembre	7 Diciembre	9 Diciembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>9 151,1</b>	<b>9 574,2</b>	<b>10 804,8</b>	<b>11 279,0</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 (CDBCRP)		150,0	300,0	500,0
Propuestas recibidas		639,1	1 185,0	1 339,5
Plazo de vencimiento		189 d	188 d	186 d
Tasas de interés Mínima		3,95	3,95	3,95
Máxima		3,96	3,95	3,95
Promedio		3,96	3,95	3,95
Saldo	<u>10 480,2</u>	<u>10 780,2</u>	<u>9 780,2</u>	<u>10 280,2</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de diciembre de 2011)	1 300,0		1 000,0	1 000,0
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de diciembre del 2011				1 200,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de Repo del 12 al 16 de diciembre del 2011			0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	600,0	300,0	300,0	
Próximo vencimiento de CDV BCRP	300,0	300,0	300,0	
Vencimientos de CDV BCRP del 12 al 16 de diciembre de 2011				
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	50,0	50,0	50,0	50,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 12 al 16 de diciembre de 2011				50,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		650,0	1 800,0	2 700,1
Propuestas recibidas		2 229,5	4 454,3	6 150,3
Plazo de vencimiento		1 d	2 d	3 d
Tasas de interés Mínima		3,90	4,08	4,05
Máxima		4,20	4,16	4,10
Promedio		4,17	4,13	4,08
Saldo	0,0	650,0	1 800,0	2 700,1
Próximo vencimiento de Depósitos (12 de diciembre de 2011)				2 700,1
Vencimientos de Depósitos del 12 al 16 de diciembre de 2011				2 700,1
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables				
Vencimientos de CDR BCRP del 12 al 16 de diciembre de 2011				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	116,0	272,4	331,6	423,2
i. Compras (millones de US\$)	43,0	101,0	123,0	157,0
Tipo de cambio promedio	2,6975	2,6970	2,6960	2,6956
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>9 267,1</b>	<b>8 896,6</b>	<b>9 036,4</b>	<b>8 502,1</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0130%	0,0130%	0,0140%	0,0143%
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	50,0
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>9 267,1</b>	<b>8 896,6</b>	<b>9 036,4</b>	<b>8 452,1</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 476,5	12 414,7	12 390,6	12 169,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,9	18,8	18,8	18,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 267,1	9 205,4	9 021,6	8 959,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,0	13,9	13,9	13,5
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	694,9	582,3	559,5	579,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,26	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	105,0	192,2	219,8	106,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,35/0,55/0,36	0,35/0,35/0,35	0,30/0,35/0,35	0,35/0,35/0,35
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	58,6	2,9	0,0	26,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>2 Diciembre</b>	<b>5 Diciembre</b>	<b>6 Diciembre</b>	<b>7 Diciembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-27,5	-9,8	34,2	24,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-61,4	-36,7	-12,9	-137,6
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>25,5</b>	<b>46,6</b>	<b>92,1</b>	<b>-6,2</b>
i. Compras	273,7	316,4	312,6	323,7
ii. (-) Ventas	248,2	269,8	220,5	329,9
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>-2,6</b>	<b>-92,4</b>	<b>109,2</b>	<b>-44,3</b>
i. Pactadas	30,1	30,2	171,9	80,0
ii. (-) Vencidas	32,7	122,6	62,7	124,3
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>-36,6</b>	<b>-119,3</b>	<b>62,0</b>	<b>-206,1</b>
i. Pactadas	73,4	98,9	126,2	97,8
ii. (-) Vencidas	109,9	218,2	64,3	303,9
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>				
i. Al contado	300,3	427,7	598,4	653,7
ii. A futuro	5,0	50,0	90,0	150,0
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>	<b>87,8</b>	<b>60,3</b>	<b>4,5</b>	<b>178,3</b>
i. Compras	106,0	175,8	64,0	295,0
ii. (-) Ventas	18,2	115,5	59,5	116,8
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	<b>-97,5</b>	<b>-48,0</b>	<b>-108,0</b>	<b>-130,1</b>
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6977	2,6973	2,6969	2,6960
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Dirección de Operaciones Monetarias y Cambiarias - Unidad Financiera