

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

| | 16 Enero | 17 Enero | 18 Enero | 19 Enero | 20 Enero |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|----------------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 9 669,9 | 9 145,8 | 8 597,3 | 8 268,6 | 7 686,3 |
| 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 (CDBCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 200,0 200,0 | 100,0 200,0 | 200,0 100,0 | 100,0 100,0 200,0 | 200,0 |
| Plazo de vencimiento | 490,3 660,0 | 353,0 548,2 | 734,4 440,4 | 457,0 354,0 692,5 | 424,5 |
| Tasas de interés Mínima | 269 d 87 d | 177 d 177 d | 176 d 267 d | 357 d. 357 d. 182 d. | 265 d |
| Máxima | 4,18 4,17 | 4,18 4,19 | 4,18 4,19 | 4,17 4,16 4,17 | 4,16 |
| Promedio | 4,19 4,19 | 4,19 4,22 | 4,21 4,20 | 4,17 4,16 4,18 | 4,20 |
| | 4,19 4,18 | 4,19 4,19 | 4,19 4,19 | 4,17 4,16 4,18 | 4,18 |
| Saldo | <u>14 290,2</u> | <u>14 590,2</u> | <u>14 890,2</u> | <u>15 290,2</u> | <u>15 490,2</u> |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (23 de enero de 2012) | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 | 100,0 |
| Vencimientos de CD BCRP del 23 al 27 de enero de 2012 | | | | 0,0 | 0,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> |
| Próximo vencimiento de Repo | | | | | 0,0 |
| Vencimientos de Repo del 23 al 27 de enero de 2012 | | | | | 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 | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP | | | | | 0,0 |
| Vencimientos de CDV BCRP del 23 al 27 de enero de 2012 | | | | | 0,0 |
| 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 | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> |
| Próximo vencimiento de CDLD BCRP | | | | | 0,0 |
| Vencimientos de CDLD BCRP del 23 al 27 de enero de 2012 | | | | | 0,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Propuestas recibidas | 3 299,9 | 3 750,0 | 3 700,0 | 3 600,0 | 3 400,0 |
| Plazo de vencimiento | 4 980,4 | 5 329,2 | 4 605,5 | 3 620,7 | 3 701,4 |
| Tasas de interés Mínima | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | 3 d |
| Máxima | 4,05 | 4,08 | 4,08 | 4,08 | 4,09 |
| Promedio | 4,15 | 4,15 | 4,15 | 4,19 | 4,20 |
| | 4,12 | 4,12 | 4,13 | 4,13 | 4,14 |
| Saldo | <u>3 299,9</u> | <u>3 750,0</u> | <u>3 700,0</u> | <u>3 600,0</u> | <u>3 400,0</u> |
| Próximo vencimiento de Depósitos (23 de enero de 2012) | | 3 750,0 | 3 700,0 | 3 600,0 | 3 400,0 |
| Vencimientos de Depósitos del 23 al 27 de enero de 2012 | | 3 750,0 | 3 700,0 | 3 600,0 | 3 400,0 |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> | <u>0,0</u> |
| Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables | | | | 0,0 | 0,0 |
| Vencimientos de CDR BCRP del 23 al 27 de enero de 2012 | | | | 0,0 | 0,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 5,4 | 0,0 | 0,0 | 306,9 | 403,7 |
| i. Compras (millones de US\$) | 2,0 | | | 114,0 | 150,0 |
| Tipo de cambio promedio | 2,6920 | | | 2,6920 | 2,6910 |
| 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 | 5 975,3 | 5 095,8 | 4 597,3 | 4 575,5 | 4 490,0 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0130% | 0,0130% | 0,0130% | 0,0130% | 0,0143% |
| 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 | 20,0 | 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 | 5 975,3 | 5 075,8 | 4 597,3 | 4 575,5 | 4 490,0 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 11 292,4 | 11 361,3 | 11 110,3 | 10 971,0 | 10 818,1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 16,5 | 16,6 | 16,3 | 16,1 | 15,9 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 7 965,6 | 7 718,1 | 7 562,6 | 7 397,9 | 7 252,5 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 11,3 | 11,4 | 11,0 | 10,8 | 10,6 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 101,8 | 110,0 | 547,0 | 529,6 | 553,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,10/4,25/4,19 | 4,15/4,15/4,15 | 4,15/4,25/4,21 | 4,20/4,25/4,21 | 4,20/4,25/4,21 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 87,0 | 201,1 | 88,0 | 127,9 | 189,2 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,30/0,80/0,51 | 0,30/0,80/0,68 | 0,25/0,80/0,71 | 0,30/0,70/0,61 | 0,30/0,65/0,55 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 1 051,2 | 59,4 | 19,2 | 0,0 | 0,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 13 Enero | 16 Enero | 17 Enero | 18 Enero | 19 Enero |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 84,5 | -64,8 | -79,3 | 42,5 | -12,3 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 160,8 | -33,9 | -94,2 | 179,1 | -18,3 |
| a. Mercado spot con el público | 152,4 | -34,2 | -78,5 | 182,8 | 84,6 |
| i. Compras | 406,9 | 249,5 | 284,9 | 368,3 | 386,7 |
| ii. (-) Ventas | 254,5 | 283,7 | 363,4 | 185,5 | 302,1 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 12,6 | -24,5 | 47,3 | -86,4 | 23,7 |
| i. Pactadas | 34,4 | 4,2 | 85,0 | 47,2 | 93,1 |
| ii. (-) Vencidas | 21,8 | 28,7 | 37,7 | 133,7 | 69,4 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 88,9 | 6,4 | 32,3 | 50,1 | 17,7 |
| i. Pactadas | 113,9 | 37,3 | 107,9 | 88,0 | 146,7 |
| ii. (-) Vencidas | 25,0 | 30,9 | 75,6 | 37,9 | 128,9 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 719,2 | 334,0 | 533,6 | 711,7 | 748,0 |
| ii. A futuro | 60,6 | 35,5 | 25,0 | 40,0 | 123,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 0,8 | 1,7 | 29,6 | -99,4 | 68,8 |
| i. Compras | 19,4 | 24,6 | 66,0 | 32,2 | 122,8 |
| ii. (-) Ventas | 18,6 | 22,8 | 36,4 | 131,6 | 54,0 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 10,9 | 0,7 | -7,5 | -0,1 | -112,2 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | 2,6939 | 2,6928 | 2,6920 | 2,6929 | 2,6923 |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | | | | | |
| (*) Datos preliminares | | | | | |