

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Nuevos Soles)

	19 Noviembre	20 Noviembre	21 Noviembre	22 Noviembre	23 Noviembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>19 112,3</b>	<b>18 607,6</b>	<b>18 407,3</b>	<b>18 019,4</b>	<b>17 666,2</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas	100,0	50,0 100,0	50,0 100,0	49,9 100,0	100,0
Plazo de vencimiento	496,0	298,0 365,1	110,0 420,2	258,5 334,8	333,0
Tasas de interés	353 d	168 d 352 d	533 d 351 d	350 d 350 d	349 d
Mínima	3,94	3,83 3,95	4,04 3,98	3,94 4,00	3,99
Máxima	4,00	3,83 4,00	4,04 4,02	4,00 4,02	4,02
Promedio	3,98	3,83 3,98	4,04 3,99	3,97 4,01	4,01
Saldo	21 410,0	21 560,0	21 710,0	21 859,9	21 959,9
Próximo vencimiento de CD BCRP (27 de noviembre de 2012)					220,0
Vencimientos de CD BCRP del 26 al 30 de noviembre de 2012					220,0
<b>v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>					
Propuestas recibidas	8 700,0	8 200,0	8 300,2	8 299,8	8 200,0
Plazo de vencimiento	9 828,6	9 619,5	9 769,0	9 867,2	9 176,7
1 d	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés	4,11	4,10	4,12	4,12	4,11
Mínima	4,16	4,17	4,17	4,17	4,17
Máxima	4,13	4,15	4,15	4,15	4,14
Promedio	8 700,0	8 200,0	8 300,2	8 299,8	8 200,0
Saldo					
Próximo vencimiento de Depósitos (26 de noviembre de 2012)			8 300,2	8 300,2	8 200,0
Vencimientos de CD BCRP del 26 al 30 de noviembre de 2012			8 300,2		8 200,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
i. Compras (millones de US\$)	52,0	52,0	51,9	51,8	51,8
Tipo de cambio promedio	20,0	20,0	20,0	20,0	20,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,5980	2,6002	2,5955	2,5900	2,5895
Tipo de cambio promedio					
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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>10 364,3</b>	<b>10 309,6</b>	<b>10 009,0</b>	<b>9 621,4</b>	<b>9 418,0</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</b>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0136%	0,0136%
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
<b>c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
<b>d. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	3,45%	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>10 364,3</b>	<b>10 309,6</b>	<b>10 009,0</b>	<b>9 621,4</b>	<b>9 418,0</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	13 296,7	13 296,7	13 296,7	13 296,7	16 432,9
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	16,9	16,9	16,9	16,9	19,8
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	13 660,5	13 277,3	13 129,0	12 980,4	12 825,5
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	12,3	12,3	12,3	12,3	15,4
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	545,6	963,0	585,5	630,5	454,7
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	4,204,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	166,7	154,7	108,2	97,0	153,7
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>	3,00/3,05/3,00	2,45/3,05/2,82	1,50/1,55/1,51	1,40/1,55/1,50	1,50/1,55/1,50
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	2 022,6	2 292,4	2 395,0	2 466,0	2 381,4
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	22,6 / 3,91	10,0 / 3,85	45,0 / 3,84		50,0 / 3,85
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)		57,4 / 4,00		71,0 / 3,99	6,0 / 3,99
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>16 Noviembre</b>	<b>19 Noviembre</b>	<b>20 Noviembre</b>	<b>21 Noviembre</b>	<b>22 Noviembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	33,3	-73,0	65,7	-32,0	-33,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	98,8	-119,6	27,9	-1,8	12,3
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>108,9</b>	<b>-82,1</b>	<b>68,3</b>	<b>-14,5</b>	<b>10,9</b>
i. Compras	324,5	314,6	310,8	263,6	272,0
(-) Ventas	215,6	396,8	242,5	278,1	261,0
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>58,8</b>	<b>108,7</b>	<b>24,4</b>	<b>-47,3</b>	<b>-37,0</b>
i. Pactadas	109,3	258,9	239,0	221,1	82,2
(-) Vencidas	50,5	150,2	214,7	268,4	119,2
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>124,3</b>	<b>62,2</b>	<b>-13,4</b>	<b>-17,1</b>	<b>8,3</b>
i. Pactadas	283,3	241,9	215,2	190,3	18,8
(-) Vencidas	159,0	179,7	228,6	207,4	10,4
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>					
i. Al contado	940,8	607,2	874,3	1070,0	926,5
A futuro	195,0	50,0	156,0	140,0	30,0
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>	<b>89,6</b>	<b>15,6</b>	<b>-7,3</b>	<b>-9,3</b>	<b>-71,5</b>
i. Compras	127,0	162,7	197,0	196,4	0,7
(-) Ventas	37,4	147,1	204,4	205,7	72,2
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	<b>8,8</b>	<b>-23,5</b>	<b>-19,1</b>	<b>-39,0</b>	<b>-36,0</b>
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6070	2,5984	2,5982	2,5966	2,5899
(*) Datos preliminares					