

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	17 Diciembre	18 Diciembre	20 Diciembre	21 Diciembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>20 947,4</b>	<b>20 590,9</b>	<b>19 873,0</b>	<b>18 860,8</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 (CD BCRP)				
Propuestas recibidas	100,0	50,0 100,0	50,0 50,0	
Plazo de vencimiento	330,0	222,5 301,0	266,5 173,1	
Tasas de interés	176 d	175 d 175 d	357 d 357 d	
Mínima	3,82	3,81 3,81	3,85 3,96	
Máxima	3,88	3,81 3,81	3,99 4,00	
Promedio	3,87	3,81 3,81	3,90 3,99	
Saldo	20 204,7	20 354,7	20 554,7	20 554,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Enero de 2013)				300,0
Vencimientos de CD BCRP del 26 al 28 de Diciembre de 2012				0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	8 650,1	9 400,1	10 880,9	9 451,8
Propuestas recibidas	11 815,5	10 982,5	10 880,9	9 451,8
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	5 d
Tasas de interés	4,02	4,03	4,05	4,04
Mínima	4,13	4,12	4,25	4,25
Máxima	4,09	4,09	4,10	4,15
Promedio	4,09	4,09	4,10	4,15
Saldo	8 650,1	9 400,1	10 880,9	9 451,8
Próximo vencimiento de Depósitos (26 de Diciembre de 2012).				9 451,8
Vencimientos de Depósitos del 26 al 28 de Diciembre de 2012				0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	205,0	153,9	128,1	102,5
i. Compras (millones de US\$)	80,0	60,0	50,0	40,0
Tipo de cambio promedio	2,5621	2,5648	2,5620	2,5620
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>12 402,3</b>	<b>11 194,7</b>	<b>9 020,2</b>	<b>9 511,5</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0137%	0,0137%	0,0137%	0,0137%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
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	400,0	0,0	30,0
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>12 402,3</b>	<b>10 794,7</b>	<b>9 020,2</b>	<b>9 481,5</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	17 902,6	17 689,1	17 113,6	17 146,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,3	21,0	20,3	20,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	14 168,4	14 020,3	13 636,2	13 438,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,9	16,6	15,9	16,0
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	576,3	235,3	358,0	382,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,15/4,25/4,24	4,10/4,25/4,22	4,15/4,25/4,18	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	124,4	288,4	52,3	252,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,00/1,00	0,90/1,00/0,96	0,80/0,90/0,83	0,75/0,95/0,86
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	22,0	45,0	42,4	88,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		20,0 / 3,82		10,5 / 3,81
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			10,0 / 3,90	30,0 / 3,90
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>14 Diciembre</b>	<b>17 Diciembre</b>	<b>19 Diciembre</b>	<b>20 Diciembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	6,5	-104,3	-53,2	129,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	43,3	-150,9	-17,9	42,9
a. Mercado spot con el público	159,3	56,1	31,6	120,8
i. Compras	393,5	291,6	293,4	400,7
ii. (-) Ventas	234,2	235,5	261,9	279,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	11,6	-106,0	7,0	48,0
i. Pactadas	41,9	136,4	192,2	148,3
ii. (-) Vencidas	30,3	242,4	192,2	100,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	48,3	-152,5	42,4	-38,8
i. Pactadas	84,4	109,1	175,9	106,8
ii. (-) Vencidas	36,1	261,6	133,5	145,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	956,1	495,8	689,6	998,3
ii. A futuro	257,0	5,0	174,0	42,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-9,4	-9,0	-47,3	17,9
i. Compras	1,2	221,2	133,2	110,7
ii. (-) Ventas	10,7	229,3	180,5	92,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-100,8	-179,7	-60,8	-50,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5630	2,5615	2,5626	2,5620
(*) Datos preliminares				