

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	26 Diciembre		27 Diciembre			28 Diciembre	29 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 666,5		7 838,2			7 744,4	8 767,8
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones							
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>							
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0	
Propuestas recibidas	261,1	235,0	290,7	295,0	227,6	200,0	
Plazo de vencimiento	262 d	87 d	170 d.	352 d.	261 d.	350 d	
Tasas de interés Mínima	4,13	4,16	4,14	4,17	4,16	4,22	
Máxima	4,17	4,17	4,20	4,22	4,20	4,25	
Promedio	4,14	4,17	4,17	4,20	4,20	4,24	
Saldo	<u>13 180,2</u>		<u>13 480,2</u>			13 480,2	13 580,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de enero de 2012)	1 200,0					1 200,0	1 200,0
Vencimientos de CD BCRP del 29 de diciembre del 2011	0,0						0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>							
Propuestas recibidas							
Plazo de vencimiento							
Tasas de interés Mínima							
Máxima							
Promedio							
Saldo	<u>0,0</u>		<u>0,0</u>			0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo							
Vencimientos de Repo del 29 de diciembre del 2011							
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</u>							
Propuestas recibidas							
Plazo de vencimiento							
Tasas de interés Mínima							
Máxima							
Promedio							
Saldo							
Próximo vencimiento de CDV BCRP							
Vencimientos de CDV BCRP del 29 de diciembre de 2011	0,0						
iv. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)</u>							
Propuestas recibidas							
Plazo de vencimiento							
Tasas de interés Mínima							
Máxima							
Promedio							
Saldo	<u>0,0</u>		<u>0,0</u>			0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP							
Vencimientos de CDLD BCRP del 29 de diciembre de 2011							
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	3 400,0		3 450,0		4 099,9	3 636,9	
Propuestas recibidas	3 879,0		4 093,7		5 114,1	3 636,9	
Plazo de vencimiento	1 d		1 d		1 d	1 d	
Tasas de interés Mínima	4,10		4,14		4,14	4,03	
Máxima	4,22		4,22		4,21	4,20	
Promedio	4,19		4,19		4,18	4,13	
Saldo	<u>3 400,0</u>		<u>3 450,0</u>		<u>4 099,9</u>	<u>3 636,9</u>	
Próximo vencimiento de Depósitos (29 de diciembre de 2011)						3 636,9	
Vencimientos de Depósitos del 29 de diciembre de 2011						3 636,9	
vi. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)</u>							
Propuestas recibidas							
Plazo de vencimiento							
Tasas de interés Mínima							
Máxima							
Promedio							
Saldo	<u>0,0</u>		<u>0,0</u>			0,0	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables							
Vencimientos de CDR BCRP del 29 de diciembre de 2011							
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	<u>0,0</u>		<u>0,0</u>			<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>							
Tipo de cambio promedio							
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>							
Tipo de cambio promedio							
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	0,0		0,0			0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>							
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>							
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>	0,0		0,0			0,0	0,0
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>							
ii. <u>Compras de BTP</u>							
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 066,5		4 088,2			3 644,5	5 030,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones							
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>							
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0130%		0,0130%		0,0130%	0,0135%	
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>							
Tasa de interés	5,05%		5,05%		5,05%	5,05%	
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>							
Tasa de interés	5,05%		5,05%		5,05%	5,05%	
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	4,5		45,0		19,2	120,1	
Tasa de interés	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	4 062,0		4 043,2			3 625,3	4 910,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 578,9		9 643,2		9 542,9	6 880,6	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,3		14,4		14,2	10,3	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 794,4		6 433,8		6 333,5	3 671,2	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,5		9,6		9,5	5,5	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP							
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	495,0		200,0		489,5	163,9	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25		4,25/4,25/4,25		4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	154,5		98,3		161,1	165,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,25/0,25		0,25/0,25/0,25		0,25/0,30/0,25	0,15/0,25/0,23	
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	20,0		0,0		245,5	54,0	
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\$)	23 Diciembre		26 Diciembre			27 Diciembre	28 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	42,7		-72,5			72,7	31,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	85,7		-122,3			-24,2	6,8
a. <u> Mercado spot con el público</u>	50,7		-129,8			-28,1	12,0
i. <u> Compras</u>	109,5		193,3			232,9	359,7
ii. <u> (-) Ventas</u>	58,8		323,1			261,0	347,7
b. <u> Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-44,7		52,9			-161,2	-2,2
i. <u> Pactadas</u>	1,5		77,9			47,0	19,1
ii. <u> (-) Vencidas</u>	46,2		25,0			208,1	21,3
c. <u> Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-1,8		3,1			-258,1	-26,5
i. <u> Pactadas</u>	0,0		3,9			37,2	115,0
ii. <u> (-) Vencidas</u>	1,8		0,8			295,3	141,5
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>							
i. <u> Al contado</u>	0,0		197,0			346,1	474,4
ii. <u> A futuro</u>	0,0		0,0			27,0	190,0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-9,5		-15,4			91,4	123,3
i. <u> Compras</u>	1,0		0,0			294,5	136,6
ii. <u> (-) Ventas</u>	10,5		15,4			203,1	13,3
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	0,0		-1,3			-0,3	-8,4
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>							
Tasa de interés							
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	-		2,6938			2,6950	2,6959

Elaboración: Dirección de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera
(*) Datos preliminares