BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	14 Noviembre		15 Noviembre		16 Noviembre	November 17		November 18
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCI	**8 662,9**		**8 522,0**		**8 316,5**	**8 607,9**		**7 869,6**
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)	300,0	200,0	100,0	300,0	500,0	60,0	500,0	50,0
Propuestas recibidas	1 173,1	817,0	577,1	1 145,8	1 741,1	316,3	1 130,9	1 169,8
Plazo de vencimiento	93 d	31 d	182 d	119 d	118 d	357 d	119 d	146 d
Tasas de interés Mínima	4,00	4,00	4,01	3,99	4,00	4,00	4,01	4,00
Máxima	4,04	4,05	4,03	4,03	4,02	4,06	4,07	4,00
Promedio	4,01	4,03	4,02	4,02	4,02	4,01	4,06	4,00
Saldo	8 900,4		9 050,3		9 550,3	10 110,3		10 160,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (1 de diciembre de 2011)			1 300,1		1 300,1	1 300,1		1 300,1
Vencimientos de CD BCRP el 18 de noviembre del 2011								
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de Repo								
Vencimientos de Repo el 18 de noviembre del 2011								
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	2 600,0		2 300,0		1 800,0	1 300,0		800,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (18 de noviembre de 2011)			500,0			0,0		200,0
Vencimientos de CDV BCRP el 18 de noviembre 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		50,00
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0		50,0		50,0	50,0		50,00
Vencimientos de CDLD BCRP el 18 de noviembre de 2011								
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 000,0		2 000,0	1 600,0	3 500,0	3 500,0		3 400,0
Propuestas recibidas	4 655,1		3 365,0	2 155,7	4 125,4	4 058,5		4 095,60
Plazo de vencimiento	1 d		1 d	1 d	1 d	1 d		3 d
Tasas de interés Mínima	4,00		4,00	4,05	4,05	4,09		4,00
Máxima	4,15		4,23	4,20	4,21	4,21		4,20
Promedio	4,05		4,17	4,15	4,16	4,17		4,13
Saldo	3 000,0		3 600,0		3 500,0	3 500,0		3 400,0
Próximo vencimiento de Depósitos (18 de noviembre de 2011)						0,0		3 400,0
Vencimientos de Depósitos el 18 de noviembre de 2011						0,0		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	590,0		590,0		590,0	590,0		590,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (22 de noviembre de 2	490,0		490,0		490,0	490,0		490,0
Vencimientos de CDR BCRP el 18 de noviembre de 2011						0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0		0,0		210,7	91,8		310,5
i. Compras (millones de US$)					78,0	34,0		115,0
Tipo de cambio promedio					2,7010	2,7008		2,7000
ii. Ventas (millones de US$)								
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$) - Tesoro Público								
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0		0,0		0,0	0,0		0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR								
ii. Compras de BTP								
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de ope	**5 162,9**		**4 522,0**		**4 527,2**	**4 639,8**		**4 730,1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones								
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).								
Comisión (tasa efectiva diaria)	1,0130%		1,0130%		1,0130%	1,0130%		1,0142%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)								
Tasa de interés	5,05%		5,05%		5,05%	5,05%		5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional								
Tasa de interés	5,05%		5,05%		5,05%	5,05%		5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0		0,0		0,0	0,0		0,0
Tasa de interés	3,45%		3,45%		3,45%	3,45%		3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operacione	**5 162,9**		**4 522,0**		**4 527,2**	**4 639,8**		**4 730,1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 477,6		7 616,4		10 299,1	10 136,8		9 992,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,2		11,8		15,9	15,6		15,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 383,2		7 383,2		7 192,5	7 025,9		6 898,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,4		7,0		11,1	10,9		10,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP						0,0		0,0
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	450,2		338,6		498,0	674,4		629,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,15/4,25/4,19		4,20/4,25/4,25		4,15/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25		4,25/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	229,0		110,4		62,1	47,7		56,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,20/0,30/0,25		0,20/0,20/0,20		0,20/0,20/0,20	0,10/0,10/0,10		0,10/0,10/0,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	99,3		10,0		39,0	60,0		35,0
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$)	**11 Noviembre**		**14 Noviembre**		**15 Noviembre**	**November 16**		**November 17**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	**-108,3**		**-22,2**		**166,5**	**-14,7**		**108,0**
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	**57,5**		**83,7**		**121,5**	**-74,3**		**45,6**
a. Mercado spot con el público	**23,3**		**88,9**		**130,4**	**12,8**		**76,4**
i. Compras	276,9		305,4		359,2	197,0		265,6
ii. (-) Ventas	253,6		216,5		228,8	184,2		189,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	**-45,1**		**59,2**		**-58,3**	**-21,6**		**84,8**
i. Pactadas	6,5		139,9		25,2	77,1		196,9
ii. (-) Vencidas	51,6		80,7		83,5	98,7		112,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	**120,7**		**165,0**		**-103,4**	**-81,2**		**22,4**
i. Pactadas	124,6		258,0		131,5	89,7		275,8
ii. (-) Vencidas	3,9		93,0		234,9	170,8		253,4
d.. Operaciones cambiarias interbancarias						0,0		0,0
i. Al contado	255,5		628,4		911,8	352,1		290,0
ii. A futuro	46,0		55,0		86,0	65,0		15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	**-17,6**		**6,1**		**142,5**	**73,8**		**144,6**
i. Compras	3,4		83,1		218,5	170,4		252,6
ii. (-) Ventas	21,0		77,0		76,0	96,6		108,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	**4,0**		**0,9**		**0,0**	**-88,7**		**-34,1**
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						0,0		0,0
Tasa de interés						0,0000%		0,0000%
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7025		2,7052		2,7056	2,7011		2,7004
(*) Datos preliminares								

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera