

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(En millones de S/.)

	08 Ene.	09 Ene.	10 Ene.	11 Ene.	12 Ene.
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	275,4	301,5	278,0	279,3	172,2
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCRP</u>					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP)					
Propuestas recibidas	327,7	180,7	195,1	116,2	56,0
Propuestas aceptadas	100,0	80,0	80,0	70,0	20,0
Plazo de vencimiento	12 semanas	6 meses	18 semanas	10 semanas	1 año
Tasas de interés					
Mínima	12,65%	12,89%	12,74%	12,49%	12,98%
Máxima	12,75%	13,02%	13,00%	12,89%	13,50%
Promedio	12,69%	12,96%	12,95%	12,72%	13,21%
Saldo de CDBCRP	1.770,2	1.850,2	1.930,2	1.960,2	1.980,2
Próximo vencimiento de CDBCRP (15 de enero del 2 001)	40,0	40,0		50,0	50,0
Vencimientos de CDBCRP del 15 al 19 de enero del 2 001	40,0	40,0		0,0	170,0
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP					
Propuestas recibidas	0,0	0,0	0,0	0,0	--
Propuestas aceptadas	0,0	0,0	0,0	0,0	--
Tasas de interés					
Mínima	--	--	--	--	--
Máxima	--	--	--	--	--
Promedio	--	--	--	--	--
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP</u>					
i. Compras (equivalente en millones de S/.)					
Monto (millones de US\$)	--	--	--	--	--
Tipo de cambio promedio	--	--	--	--	--
ii. Ventas (equivalente en millones de S/.)					
Monto (millones de US\$)	--	--	--	--	--
Tipo de cambio promedio	--	--	--	--	--
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Antes de operaciones de compra temporal de CDBCRP	175,4	221,5	198,0	209,3	152,2
b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP	175,4	221,5	198,0	209,3	152,2
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	--
Monto (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	--
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,01720%	0,01720%	0,01720%	0,01720%	0,01720%
b. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Monto	0,0	0,0	0,0	0,0	--
Tasa de interés	--	--	--	--	--
c. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>					
Monto	0,0	0,0	0,0	0,0	--
Tasa de interés	--	--	--	--	--
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones	175,4	221,5	198,0	209,3	152,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	831,5	833,7	832,8	834,2	829,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	7,7	7,7	7,7	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	165,1	171,1	173,5	176,5	174,3
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,5	1,6	1,6	1,6	1,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>					
i. Monto	169,7	97,9	101,0	100,0	106,6
ii. Tasas de interés					
Mínima	10,00%	10,00%	10,50%	10,00%	10,75%
Máxima	12,00%	11,50%	12,00%	12,50%	12,50%
Promedio	10,94%	10,92%	10,93%	10,87%	11,22%
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>					
i. Monto	129,0	104,4	112,3	91,9	116,7
ii. Tasas de interés					
Mínima	6,25%	6,25%	6,25%	6,25%	6,25%
Máxima	9,25%	9,25%	9,75%	9,25%	9,50%
Promedio	9,01%	8,93%	9,01%	8,90%	8,88%
c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>					
i. Monto	10,8	12,3	6,2	3,5	5,0
ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador)					
Mínima	11,00%	12,00%	12,00%	13,00%	11,00%
Máxima	12,00%	12,74%	12,00%	13,00%	12,68%
Promedio	11,56%	12,18%	12,00%	13,00%	12,01%
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
a. <u>Flujo de la posición de cambios (**)</u>					
i. Compras al contado al público	79,7	62,9	68,1	87,9	70,8
ii. Ventas al contado al público	91,4	61,4	67,4	75,8	61,1
iii. Compras a futuro pactadas con el público	50,6	18,8	8,5	3,5	13,4
iv. Ventas a futuro pactadas con el público	15,3	30,0	0,0	18,7	18,0
v. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público	5,9	8,6	16,9	8,8	5,7
vi. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público	0,3	0,1	0,4	24,6	8,0
b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>					
i. Al contado	48,3	37,8	48,9	79,0	55,1
ii. A futuro	0,4	2,0	0,0	--	2,0
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
i. Monto	--	--	--	--	--
ii. Tasa de interés	8,50%	8,50%	8,50%	8,50%	8,50%

* Datos preliminares

** Datos preliminares para el último día