

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

| | 20 Diciembre | | | 21 Diciembre | | | 22 Diciembre | | |
|--|---------------------|---------|---------|---------------------|-------|---------|---------------------|---------|--|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 13 134,7 | | | 11 906,9 | | | 11 301,7 | | |
| 2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones | | | | | | | | | |
| Saldo | 340,0 | | | 340,0 | | | 340,0 | | |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (27 de diciembre de 2010) | 0,0 | | | 0,0 | | | 0,0 | | |
| Vencimientos de CD BCRP al 23 de diciembre de 2010 | 0,0 | | | 0,0 | | | 0,0 | | |
| 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 | 3 195,8 | | | 3 195,8 | | | 3 195,8 | | |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de enero de 2011) | 100,0 | | | 100,0 | | | 100,0 | | |
| Vencimientos de CDV BCRP al 23 de diciembre del 2010 | 0,0 | | | 0,0 | | | 0,0 | | |
| iv. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)</u> | | | | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | | | | |
| Tasas de interés | | | | | | | | | |
| Mínima | | | | | | | | | |
| Máxima | | | | | | | | | |
| Promedio | | | | | | | | | |
| Saldo | 450,0 | | | 450,0 | | | 450,0 | | |
| Próximo vencimiento de CDLD BCRP (19 de enero de 2011) | 100,0 | | | 100,0 | | | 100,0 | | |
| Vencimientos de CDLD BCRP 23 de diciembre del 2010 | 0,0 | | | 0,0 | | | 0,0 | | |
| v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u> | 5 000,0 | 1 500,0 | 1 991,8 | 5 000,0 | 481,0 | 1 800,1 | 4 000,0 | 3 000,1 | |
| Propuestas recibidas | 5 046,8 | 2 220,0 | 1 991,8 | 5 501,2 | 881,0 | 2 411,8 | 5 045,5 | 4 061,0 | |
| Plazo de vencimiento | 1 d. | 14 d. | 1 d. | 1 d. | 14 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. | |
| Tasas de interés | 2,99 | 3,00 | 2,96 | 3,00 | 3,00 | 2,98 | 2,98 | 2,97 | |
| Mínima | 3,00 | 3,02 | 3,00 | 3,00 | 3,02 | 3,00 | 3,00 | 3,00 | |
| Máxima | 3,00 | 3,00 | 3,00 | 3,00 | 3,02 | 3,00 | 2,99 | 2,99 | |
| Promedio | 3,00 | 3,00 | 3,00 | 3,00 | 3,02 | 3,00 | 2,99 | 2,99 | |
| Saldo | 19 041,4 | | | 18 830,7 | | | 19 030,7 | | |
| Próximo vencimiento de Depósitos (23 diciembre del 2010) | 7 491,8 | | | | | | 7 000,1 | | |
| Vencimientos de Depósitos al 23 de diciembre del 2009 | 7 491,8 | | | | | | 7 000,1 | | |
| vi. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u> | | | | | | | | | |
| Saldo | | | | | | | | | |
| Próximo vencimiento de Repo (22 de diciembre de 2010) | | | | | | | | | |
| Vencimientos de REPO del 22 al 23 de diciembre de 2010 | | | | | | | | | |
| b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</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 | | |
| 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> | | | | | | | | | |
| 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 | 4 642,9 | | | 4 625,8 | | | 4 301,6 | | |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | | | | | |
| a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u> | | | | | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0089% | | | 0,0089% | | | 0,0089% | | |
| b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u> | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | 3,80% | | | 3,80% | | | 3,80% | | |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u> | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | 3,80% | | | 3,80% | | | 3,80% | | |
| d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u> | 0,0 | | | 11,0 | | | 5,7 | | |
| Tasa de interés | 2,20% | | | 2,20% | | | 2,20% | | |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 4 642,9 | | | 4 614,8 | | | 4 295,9 | | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 2 462,2 | | | 2 462,2 | | | 2 462,2 | | |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 4,0 | | | 4,0 | | | 4,0 | | |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 0,0 | | | 0,0 | | | 0,0 | | |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 0,0 | | | 0,0 | | | 0,0 | | |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | | | | | |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u> | 684,6 | | | 857,6 | | | 766,6 | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 3,00/3,00/3,00 | | | 3,00/3,00/3,00 | | | 3,00/3,00/3,00 | | |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u> | 95,3 | | | 120,0 | | | 51,9 | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,25/0,30/0,26 | | | 0,25/0,30/0,26 | | | 0,20/0,30/0,25 | | |
| c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u> | 190,0 | | | 70,0 | | | 70,0 | | |
| 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\$) | 17 Diciembre | | | 20 Diciembre | | | 21 Diciembre | | |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | -24,1 | | | -10,7 | | | 7,6 | | |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 36,5 | | | -27,0 | | | 77,1 | | |
| a. <u>Mercado spot con el público</u> | 48,2 | | | 3,7 | | | 105,9 | | |
| i. <u>Compras</u> | 318,5 | | | 265,7 | | | 436,7 | | |
| ii. <u>(-) Ventas</u> | 270,4 | | | 262,0 | | | 330,8 | | |
| b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u> | -17,7 | | | -33,3 | | | -23,2 | | |
| i. <u>Pactadas</u> | 36,2 | | | 117,1 | | | 76,0 | | |
| ii. <u>(-) Vencidas</u> | 54,0 | | | 150,4 | | | 99,2 | | |
| c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u> | 42,8 | | | -49,5 | | | 46,3 | | |
| i. <u>Pactadas</u> | 79,6 | | | 71,4 | | | 204,8 | | |
| ii. <u>(-) Vencidas</u> | 36,8 | | | 120,9 | | | 158,5 | | |
| d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u> | | | | | | | | | |
| i. <u>Al contado</u> | 312,8 | | | 357,4 | | | 659,3 | | |
| ii. <u>A futuro</u> | 40,0 | | | 148,0 | | | 120,0 | | |
| e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u> | -28,5 | | | -48,1 | | | 49,1 | | |
| i. <u>Compras</u> | 15,0 | | | 84,9 | | | 145,4 | | |
| ii. <u>(-) Ventas</u> | 43,6 | | | 133,0 | | | 96,3 | | |
| f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u> | -0,4 | | | -12,0 | | | -18,6 | | |
| g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u> | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,8179 | | | 2,8096 | | | 2,8042 | | |
| (*) Datos preliminares | | | | | | | | | |

d. = día(s)

s. = semana(s)

m. = mes(es)

a. = año(s)

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera