

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	21 Noviembre	22 Noviembre	23 Noviembre	24 Noviembre	25 Noviembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>7 826,1</b>	<b>8 143,4</b>	<b>7 885,1</b>	<b>7 707,6</b>	<b>7 601,0</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
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	60,0
Propuestas recibidas		471,0	358,4	414,0	340,5
Plazo de vencimiento		175 d	175 d	174 d	350 d
Tasas de interés Mínima		4,00	3,99	3,98	3,96
Máxima		4,03	3,99	3,98	4,00
Promedio		4,01	3,99	3,98	4,00
Saldo	10 160,3	10 360,3	10 460,3	10 820,3	11 120,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (1 de diciembre de 2011)	1 300,1	1 300,1	1 300,1	1 300,1	1 300,1
Vencimientos de CD BCRP del 28 de noviembre al 2 de diciembre del 2011	0,0			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					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de Repo del 28 de noviembre al 2 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	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (5 de diciembre de 2011)	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimientos de CDV BCRP del 28 de noviembre al 2 de diciembre de 2011					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	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 28 de noviembre al 2 de diciembre de 2011					0,0
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	3 800,1	3 999,9	3 800,1	3 800,0	3 700,0
Propuestas recibidas	4 721,3	4 681,5	4 849,0	5 331,6	3 877,4
Plazo de vencimiento		1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,06	4,10	4,10	4,10	4,10
Máxima	4,20	4,20	4,20	4,19	4,19
Promedio	4,14	4,16	4,17	4,18	4,16
Saldo	3 800,1	3 999,9	3 800,1	3 800,0	3 700,0
Próximo vencimiento de Depósitos (28 de noviembre de 2011)					3 700,0
Vencimientos de Depósitos del 28 de noviembre al 2 de diciembre de 2011					3 700,0
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	590,0	100,0	100,0	100,0	
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables	490,0	100,0	100,0		
Vencimientos de CDR BCRP el 25 de noviembre de 2011					
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	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	0,0
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>					
ii. <u>Compras de BTP</u>					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4 026,0</b>	<b>3 943,5</b>	<b>3 985,0</b>	<b>3 547,6</b>	<b>3 601,0</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	1,0130%	1,0130%	1,0130%	1,0130%	1,0420%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,05%	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%	5,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	83,5	11,7	0,0	8,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	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>3 942,5</b>	<b>3 931,8</b>	<b>3 985,0</b>	<b>3 539,6</b>	<b>3 601,0</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 634,6	9 731,4	9 616,1	9 302,0	9 211,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,8	15,0	14,8	14,3	14,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 765,8	6 637,0	6 323,6	6 221,9	6 117,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,1	10,2	10,1	9,6	9,4
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	326,0	358,5	248,1	131,5	210,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	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>	45,3	36,8	2,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10		
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	0,0	15,0	25,0	10,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>18 Noviembre</b>	<b>21 Noviembre</b>	<b>22 Noviembre</b>	<b>23 Noviembre</b>	<b>24 Noviembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-68,5	-16,6	-17,1	0,1	59,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-94,1	121,6	-91,7	101,9	57,4
a. <u> Mercado spot con el público</u>	61,7	109,6	70,0	97,8	45,4
i. <u>Compras</u>	270,3	276,5	289,3	310,5	210,6
ii. <u>(-) Ventas</u>	208,6	166,8	219,3	212,7	165,2
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-16,1	71,5	-102,3	-138,2	2,7
i. <u>Pactadas</u>	126,9	134,0	95,2	304,6	43,5
ii. <u>(-) Vencidas</u>	143,1	62,5	197,5	442,8	40,8
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-41,7	209,7	-176,9	-36,4	1,2
i. <u>Pactadas</u>	127,6	217,7	171,9	497,3	1,3
ii. <u>(-) Vencidas</u>	169,3	8,0	348,8	533,7	0,1
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u>Al contado</u>	458,0	152,0	463,4	475,9	272,4
ii. <u>A futuro</u>	10,0	34,0	40,0	159,0	47,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-14,6	-46,6	165,8	88,1	-28,4
i. <u>Compras</u>	118,8	6,7	346,6	528,0	0,0
ii. <u>(-) Ventas</u>	133,4	53,3	180,8	439,9	28,4
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-114,9	4,0	-176,2	6,9	-0,2
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés	2,6999	2,7018	2,7017	2,7064	2,7071
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)					
Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera					
(*) Datos preliminares					