

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	28 Noviembre	29 Noviembre	30 Noviembre	1 Diciembre	2 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 497,5	7 324,6	6 963,8	8 125,0	8 745,3
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)		100,0	100,0		
Propuestas recibidas	400,0	1 348,3	419,3	60,0	244,1
Plazo de vencimiento	169 d	168 d	254 d	378 d	3,94
Tasas de interés: Mínima	3,96	3,97	3,94	3,98	3,96
Máxima	3,97	3,97	3,96	3,98	3,96
Promedio	3,97	3,97	3,95	3,96	3,96
Saldo	11 520,3	11 720,3	11 720,3	10 480,2	10 480,2
Próximo vencimiento de CD BCRP (1 de diciembre de 2011)	1 300,1	1 300,1	1 300,1		1 300,0
Vencimientos de CD BCRP del 1 al 2 de diciembre del 2011					1 300,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo				0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo	0,0	0,0	0,0		0,0
Vencimientos de Repo del 1 al 2 de diciembre del 2011					0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
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 1 al 2 de diciembre de 2011					800,0
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	50,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 1 al 2 de diciembre de 2011					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	2 459,3	2 528,9	3 320,4		
Propuestas recibidas	2 459,3	2 528,9	3 320,4		
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d		
Tasas de interés: Mínima	4,10	4,13	4,00		
Máxima	4,25	4,25	4,25		
Promedio	4,17	4,20	4,20		
Saldo	2 459,3	2 528,9	3 320,4	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos (1 de diciembre de 2011)					
Vencimientos de Depósitos del 1 al 2 de diciembre de 2011					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo				0,0	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables					
Vencimientos de CDR BCRP del 1 al 2 de diciembre de 2011					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	307,8	879,9	261,7
i. Compras (millones de US\$)			114,0	326,0	97,0
Tipo de cambio promedio			2,7000	2,6990	2,6980
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 operaciones	4 638,2	4 595,7	3 951,2	8 944,9	9 007,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0143%
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					
Tasa de interés	20,0	0,0	30,1	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 operaciones	4 618,2	4 595,7	3 921,1	8 944,9	9 007,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 882,4	8 841,3	8 780,4	12 039,3	12 185,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,7	13,6	13,5	33,3	23,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 788,0	5 746,9	5 747,6	8 944,9	8 975,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,9	8,8	8,8	24,8	17,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	264,0	309,0	559,0	561,9	714,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,23	4,20/4,25/4,24	4,20/4,30/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,0	21,0	19,0	95,0	189,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,25/0,25/0,25	0,25/0,35/0,34
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	20,6	22,5	25,0	85,0	66,8
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\$)	25 Noviembre	28 Noviembre	29 Noviembre	30 Noviembre	1 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-42,6	-144,4	-25,8	90,0	50,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	7,4	-17,9	2,2	-149,3	-207,0
a. Mercado spot con el público	46,4	-23,5	0,5	-32,3	115,2
i. Compras	264,4	238,6	293,3	341,2	330,3
ii. (-) Ventas	218,0	262,2	292,9	373,6	215,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	143,7	16,4	97,1	-74,3	-24,5
i. Pactadas	205,9	133,9	177,8	241,7	74,3
ii. (-) Vencidas	62,2	117,5	80,7	316,1	98,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	193,7	142,8	125,0	-313,7	-282,0
i. Pactadas	398,7	438,9	211,9	311,8	30,7
ii. (-) Vencidas	205,0	296,1	86,9	625,4	312,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	515,0	457,2	378,8	677,3	698,0
ii. A futuro	147,0	60,0	157,0	53,0	48,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	135,3	181,3	9,0	313,8	215,0
i. Compras	193,8	294,4	86,5	618,7	303,4
ii. (-) Ventas	58,5	113,2	77,5	304,9	88,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-31,5	2,9	-1,1	-121,5	-323,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7135	2,7082	2,7057	2,6999	2,6989
(*) Datos preliminares					