

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	12 Diciembre	13 Diciembre	14 Diciembre	15 Diciembre	16 Diciembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>11 376,6</b>	<b>10 921,7</b>	<b>10 893,9</b>	<b>10 449,1</b>	<b>9 552,4</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)					
Propuestas recibidas	700,0	200,0	500,0	100,0	100,0
Plazo de vencimiento	1 896,8	686,6	2034,1	458,5	1 744,0
Tasas de interés: Mínima	185 d	27 d	274 d	359,7	379,6
Máxima	3,95	3,95	3,95	3,99	3,95
Promedio	4,04	4,06	4,05	4,07	4,07
Saldo	4,01	3,99	4,00	4,03	4,07
Próximo vencimiento de CD BCRP	10 980,2	10 780,2	11 380,2	11 780,2	11 980,2
Vencimientos de CD BCRP el 16 de diciembre del 2011		200,0	200,0		1 200,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de Repo el 16 de diciembre del 2011			0,0		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					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP el 16 de diciembre 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	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP		50,0			0,0
Vencimientos de CDLD BCRP el 16 de diciembre de 2011					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 000,1	4 100,0	999,9	4 200,0	5 000,5
Propuestas recibidas	6 305,3	6 916,5	3 918,0	5 290,4	3 790,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	4,00	3,99	4,00	4,03	4,02
Máxima	4,08	4,06	4,05	4,10	4,06
Promedio	4,04	4,03	4,03	4,05	4,04
Saldo	3 000,1	4 100,0	5 199,9	5 700,0	5 000,5
Próximo vencimiento de Depósitos (16 de diciembre de 2011)					5 000,5
Vencimientos de Depósitos el 16 de diciembre de 2011					5 000,5
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	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables					0,0
Vencimientos de CDR BCRP el 16 de diciembre de 2011					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	568,6	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)		211,0			
Tipo de cambio promedio		2,6950			
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>7 676,5</b>	<b>6 590,3</b>	<b>5 094,0</b>	<b>4 149,1</b>	<b>4 351,9</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
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	79,8	88,0	0,0	0,0	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>7 596,7</b>	<b>6 502,3</b>	<b>5 094,0</b>	<b>4 149,1</b>	<b>4 351,9</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 971,1	11 981,8	11 548,8	7 358,4	7 371,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,0	18,0	17,3	11,0	11,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 961,6	8 763,0	8 339,4	4 149,1	4 161,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,2	13,1	12,5	6,2	6,2
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	661,5	625,0	646,6	479,5	618,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,25/4,24	4,05/4,25/4,19	4,00/4,30/4,18	4,10/4,25/4,19	4,20/4,25/4,23
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	229,7	131,4	151,8	161,0	97,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,25/0,25	0,25/0,25/0,25	0,20/0,35/0,24	0,15/0,25/0,17	0,15/0,25/0,21
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	13,4	23,2	108,5	9,0	46,0
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>9 Diciembre</b>	<b>12 Diciembre</b>	<b>13 Diciembre</b>	<b>14 Diciembre</b>	<b>15 Diciembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-99,8	93,0	-57,2	45,7	-129,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-110,8	159,2	-97,0	59,6	-42,1
a. Mercado spot con el público	112,7	160,2	105,3	73,7	-59,1
i. Compras	392,9	482,0	392,7	354,0	393,3
ii. (-) Ventas	280,1	321,8	287,4	280,3	452,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	71,3	-66,3	-14,1	8,8	-70,3
i. Pactadas	142,8	81,8	136,6	84,3	63,0
ii. (-) Vencidas	71,5	148,0	150,7	75,4	133,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	60,3	-0,1	-53,8	22,8	17,5
i. Pactadas	251,9	122,9	73,2	97,3	218,8
ii. (-) Vencidas	191,6	123,0	127,0	74,5	201,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	438,9	446,6	914,9	481,5	329,9
ii. A futuro	80,0	30,0	45,0	90,0	100,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	66,1	-27,1	-14,2	-13,4	85,4
i. Compras	132,6	117,7	124,4	54,9	152,4
ii. (-) Ventas	66,5	144,8	138,6	68,3	67,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-169,5	1,1	-211,8	-1,6	-0,4
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6959	2,7011	2,6955	2,6974	2,6951
(*) Datos preliminares					