BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	19 Diciembre	20 Diciembre	21 Diciembre	22 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**9 037,8**	**8 277,6**	**8 102,8**	**7 455,6**
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)	100,0 200,0	100,0 100,0	100,0 100,0	100,0 100,0 100,0
Propuestas recibidas	328,0 682,0	266,0 354,0	351,0 314,0	320,0 319,3 338,0
Plazo de vencimiento	360 d 269 d	177 d 268 d	358 d 267 d	357 d. 32 d. 91 d.
Tasas de interés Mínima	4,04 4,08	4,05 4,05	4,08 4,08	4,10 4,08 4,12
Máxima	4,10 4,08	4,10 4,12	4,12 4,13	4,15 4,15 4,16
Promedio	4,09 4,08	4,08 4,09	4,11 4,11	4,12 4,14 4,14
Saldo	12 280,2	12 480,2	12 680,2	12 980,2
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de enero de 2012)		1 200,0	1 200,0	1 200,0
Vencimientos de CD BCRP el 22 de diciembre del 2011				0,0
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
Próximo vencimiento de Repo		0,0		0,0
Vencimientos de Repo el 22 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				
Próximo vencimiento de CDV BCRP				
Vencimientos de CDV BCRP el 22 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	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP		0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDLD BCRP el 22 de diciembre de 2011				0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 517,5	3 900,0	3 853,5	3 000,0
Propuestas recibidas	4 517,5	4 733,3	3 853,5	3 139,9
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	4 d
Tasas de interés Mínima	4,10	4,10	4,13	4,08
Máxima	4,25	4,23	4,23	4,22
Promedio	4,20	4,20	4,20	4,18
Saldo	4 517,5	3 900,0	3 853,5	3 000,0
Próximo vencimiento de Depósitos (22 de diciembre de 2011)				3 000,0
Vencimientos de Depósitos el 22 de diciembre de 2011				3 000,0
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
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables	0,0	0,0		0,0
Vencimientos de CDR BCRP el 22 de diciembre de 2011				0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	2,7	406,8	129,3	517,1
i. Compras (millones de US$)	1,0	151,0	48,0	192,0
Tipo de cambio promedio	2,6950	2,6940	2,6940	2,6930
ii. Ventas (millones de US$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 223,0**	**4 584,4**	**4 178,6**	**4 672,7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0135%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	41,0	0,0	4,4
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 223,0**	**4 543,4**	**4 178,6**	**4 668,3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 711,0	10 563,1	10 334,6	10 233,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,2	15,0	15,4	15,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 501,7	7 272,6	7 136,2	7 024,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,6	10,4	10,6	10,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	510,9	691,7	423,0	690,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,26
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	63,7	138,7	185,2	275,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,15	0,15/0,25/0,18	0,25/0,40/0,31
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	13,0	21,0	35,0	0,0
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$)	**16 Diciembre**	**19 Diciembre**	**20 Diciembre**	**21 Diciembre**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	**133,5**	**109,1**	**-114,3**	**62,5**
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	**79,6**	**92,7**	**-128,5**	**24,3**
a. Mercado spot con el público	**82,9**	**97,2**	**28,9**	**100,5**
i. Compras	430,9	378,4	315,3	380,6
ii. (-) Ventas	348,0	281,3	286,4	280,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	**1,6**	**-87,4**	**-0,3**	**-0,3**
i. Pactadas	42,6	66,7	45,7	65,3
ii. (-) Vencidas	41,1	154,2	46,0	65,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	**-52,3**	**-103,8**	**-14,5**	**-38,5**
i. Pactadas	54,2	125,8	56,3	172,0
ii. (-) Vencidas	106,6	229,7	70,8	210,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	390,5	253,5	1045,0	636,0
ii. A futuro	115,0	80,0	40,0	95,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	**56,8**	**78,8**	**19,8**	**116,9**
i. Compras	95,3	225,5	62,3	179,1
ii. (-) Ventas	38,5	146,6	42,5	62,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	**5,5**	**-7,8**	**-152,4**	**-48,2**
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6968	2,6971	2,6940	2,6941
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera