

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	2 Enero	3 Enero	4 Enero	5 Enero	6 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8 834,4	9 022,9	9 156,3	9 072,0	8 847,2
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)					
Propuestas recibidas		100,0	300,0	100,0	400,0
Plazo de vencimiento		422,1	1 068,9	434,5	1 278,6
Tasas de interés Mínima		191 d	97 d	371 d	96 d
Máxima		4,18	4,14	4,20	4,17
Promedio		4,18	4,19	4,20	4,22
Saldo	13 580,2	13 680,2	13 980,2	14 480,2	14 880,2
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de enero de 2012)	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0
Vencimientos de CD BCRP del 9 al 13 de enero de 2012			0,0	0,0	2 490,0
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
Vencimientos de Repo del 9 al 13 de enero de 2012				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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP				0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 9 al 13 de enero de 2012				0,0	0,0
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP				0,0	0,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 9 al 13 de enero de 2012				0,0	0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
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 Depósitos				0,0	0,0
Vencimientos de Depósitos del 9 al 13 de enero de 2012				0,0	0,0
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	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables				0,0	0,0
Vencimientos de CDR BCRP del 9 al 13 de enero de 2012				0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	2,7
i. Compras (millones de US\$)					1,0
Tipo de cambio promedio					2,6920
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	8 834,4	8 922,9	8 856,3	8 572,0	8 449,8
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	50,0	123,0	143,0	114,0	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	8 784,4	8 799,9	8 713,3	8 458,0	8 449,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 675,7	10 529,4	10 835,2	11 072,8	11 475,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,1	17,5	16,0	16,4	16,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 238,7	6 788,3	7 269,5	7 507,2	7 910,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,0	11,8	10,8	11,1	11,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	493,3	584,8	638,5	572,4	755,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	108,8	65,8	49,0	138,0	84,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,30/0,26	0,40/0,40/0,40	0,40/0,60/0,57	0,40/1,00/0,72	1,00/1,75/1,60
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	10,0	650,0	1 490,0	480,0	1 180,0
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\$)	30 Diciembre	2 Enero	3 Enero	4 Enero	5 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	85,1	29,7	-15,6	53,5	-15,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	45,7	21,3	-93,0	138,3	6,0
a. Mercado spot con el público	47,2	38,8	-83,5	156,8	4,8
i. Compras	122,3	233,0	197,1	357,9	220,9
ii. (-) Ventas	75,0	194,3	280,5	201,1	216,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-6,7	0,5	38,2	48,5	-5,0
i. Pactadas	4,0	4,3	55,8	98,9	84,9
ii. (-) Vencidas	10,6	3,8	17,6	50,4	89,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-46,1	-7,9	-39,2	133,2	16,8
i. Pactadas	28,0	0,2	52,0	148,2	163,3
ii. (-) Vencidas	74,1	8,1	91,2	15,0	146,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0,0	121,5	417,5	445,9	419,7
ii. A futuro	0,0	25,0	140,0	20,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	61,9	-0,1	64,0	-38,0	54,5
i. Compras	68,4	1,0	76,4	12,0	142,5
ii. (-) Ventas	6,5	1,2	12,4	50,0	88,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-13,0	0,0	-16,0	3,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	-	2,6979	2,6948	2,6959	2,6939
(*) Datos preliminares					