

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	16 Enero	17 Enero	18 Enero	19 Enero	20 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 669,9	9 145,8	8 597,3	8 268,6	7 686,3
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)					
Propuestas recibidas	200,0 200,0	100,0 200,0	200,0 100,0	100,0 100,0 200,0	200,0
Plazo de vencimiento	490,3 660,0	353,0 548,2	734,4 440,4	457,0 354,0 692,5	424,5
Tasas de interés Mínima	269 d 87 d	177 d 177 d	176 d 267 d	357 d. 357 d. 182 d.	265 d
Máxima	4,18 4,17	4,18 4,19	4,18 4,19	4,17 4,16 4,17	4,16
Promedio	4,19 4,19	4,19 4,22	4,21 4,20	4,17 4,16 4,18	4,20
Saldo	4,19 4,18	4,19 4,19	4,19 4,19	4,17 4,16 4,18	4,18
Próximo vencimiento de CD BCRP (23 de enero de 2012)	14 290,2	14 590,2	14 890,2	15 290,2	15 490,2
Vencimientos de CD BCRP del 23 al 27 de enero de 2012	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
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					
Vencimientos de Repo del 23 al 27 de enero de 2012					
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					
Vencimientos de CDV BCRP del 23 al 27 de enero de 2012					
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					
Vencimientos de CDLD BCRP del 23 al 27 de enero de 2012					
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	3 299,9	3 750,0	3 700,0	3 600,0	3 400,0
Plazo de vencimiento	4 980,4	5 329,2	4 605,5	3 620,7	3 701,4
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,05	4,08	4,08	4,08	4,09
Promedio	4,15	4,15	4,15	4,19	4,20
Saldo	4,12	4,12	4,13	4,13	4,14
Próximo vencimiento de Depósitos (23 de enero de 2012)	3 299,9	3 750,0	3 700,0	3 600,0	3 400,0
Vencimientos de Depósitos del 23 al 27 de enero de 2012		3 750,0	3 700,0	3 600,0	3 400,0
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 23 al 27 de enero de 2012				0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	5,4	0,0	0,0	306,9	403,7
i. Compras (millones de US\$)	2,0			114,0	150,0
Tipo de cambio promedio	2,6920			2,6920	2,6910
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	5 975,3	5 095,8	4 597,3	4 575,5	4 490,0
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	0,0	20,0	0,0	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	5 975,3	5 075,8	4 597,3	4 575,5	4 490,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	11 292,4	11 361,3	11 110,3	10 971,0	10 818,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,5	16,6	16,3	16,1	15,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 965,6	7 718,1	7 562,6	7 397,9	7 252,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,3	11,4	11,0	10,8	10,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	101,8	110,0	547,0	529,6	553,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,25/4,19	4,15/4,15/4,15	4,15/4,25/4,21	4,20/4,25/4,21	4,20/4,25/4,21
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	87,0	201,1	88,0	127,9	189,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,30/0,80/0,51	0,30/0,80/0,68	0,25/0,80/0,71	0,30/0,70/0,61	0,30/0,65/0,55
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	1 051,2	59,4	19,2	0,0	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\$)	13 Enero	16 Enero	17 Enero	18 Enero	19 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	84,5	-64,8	-79,3	42,5	-12,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	160,8	-33,9	-94,2	179,1	-18,3
a. Mercado spot con el público	152,4	-34,2	-78,5	182,8	84,6
i. Compras	406,9	249,5	284,9	368,3	386,7
ii. (-) Ventas	254,5	283,7	363,4	185,5	302,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	12,6	-24,5	47,3	-86,4	23,7
i. Pactadas	34,4	4,2	85,0	47,2	93,1
ii. (-) Vencidas	21,8	28,7	37,7	133,7	69,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	88,9	6,4	32,3	50,1	17,7
i. Pactadas	113,9	37,3	107,9	88,0	146,7
ii. (-) Vencidas	25,0	30,9	75,6	37,9	128,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	719,2	334,0	533,6	711,7	748,0
ii. A futuro	60,6	35,5	25,0	40,0	123,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0,8	1,7	29,6	-99,4	68,8
i. Compras	19,4	24,6	66,0	32,2	122,8
ii. (-) Ventas	18,6	22,8	36,4	131,6	54,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	10,9	0,7	-7,5	-0,1	-112,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés	2,6939	2,6928	2,6920	2,6929	2,6923
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)					
(*) Datos preliminares					