

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	23 Enero	24 Enero	25 Enero	26 Enero	27 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 645,6	7 762,0	7 802,5	7 779,2	8 387,1
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	100,0	100,0	100,0	100,0
Plazo de vencimiento	291,4	232,5	180,0	149,1	149,1
Tasas de interés Mínima	269 d	177 d	268 d	78 d	350 d
Máxima	4,18	4,17	4,24	4,17	4,17
Promedio	4,25	4,21	4,25	4,22	4,25
Saldo	4,21	4,19	4,25	4,20	4,22
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de febrero de 2012)	15 590,2	15 790,2	15 890,2	15 990,2	15 990,2
Vencimientos de CD BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2012	200,1	200,1	200,1	200,1	200,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 Repodel 30 de enero al 3 de febrero 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 30 de enero al 3 de febrero 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 30 de enero al 3 de febrero de 2012					
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	3 308,8	3 113,9	3 168,7	3 299,9	3 884,4
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,09	4,13	4,17	4,17	4,15
Máxima	4,25	4,25	4,25	4,25	4,25
Promedio	4,17	4,22	4,23	4,21	4,20
Saldo	3 308,8	3 113,9	3 168,7	3 299,9	3 884,4
Próximo vencimiento de Depósitos (30 de enero de 2012)	3 308,8	3 113,9	3 168,7	3 299,9	3 884,4
Vencimientos de Depósitos del 30 de enero al 3 de febrero de 2012	3 308,8	3 113,9	3 168,7	3 299,9	3 884,4
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					
Vencimientos de CDR BCRP del 30 de enero al 3 de febrero de 2012					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	391,5	0,0	0,0	562,2	191,0
i. Compras (millones de US\$)	145,5			209,0	71,0
Tipo de cambio promedio	2,6910			2,6900	2,6900
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	4 528,3	4 448,1	4 533,8	4 941,5	4 693,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0131%	0,0131%	0,0130%	0,0131%	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	0,0	0,0	0,0	0,0	45,0
	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	4 528,3	4 448,1	4 533,8	4 941,5	4 648,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 456,7	10 566,0	10 247,2	10 173,3	10 082,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,3	15,3	15,0	14,9	14,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 111,4	6 771,1	6 674,3	6 588,7	6 516,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,1	10,3	9,8	9,7	9,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	882,6	910,6	517,0	642,0	645,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,21	4,20/4,25/4,22	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,22	4,15/4,30/4,23
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	189,0	117,0	274,0	210,0	216,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40/0,60/0,49	0,40/0,50/0,43	0,40/0,50/0,44	0,40/0,50/0,45	0,40/1,00/0,60
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	125,0	12,5	56,1	112,0	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\$)	20 Enero	23 Enero	24 Enero	25 Enero	26 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	74,2	-133,9	70,4	190,2	-111,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	38,1	-194,9	98,7	128,0	-42,1
a. Mercado spot con el público	248,2	-44,4	98,4	135,3	164,9
i. Compras	468,1	232,2	329,5	362,7	427,3
ii. (-) Ventas	219,9	276,6	231,2	227,4	262,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-52,9	36,6	88,5	95,8	-88,7
i. Pactadas	71,4	60,3	137,5	178,7	37,8
ii. (-) Vencidas	124,3	23,7	49,0	83,0	126,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-89,0	-24,3	116,8	33,5	-19,7
i. Pactadas	77,3	12,1	127,2	142,9	172,9
ii. (-) Vencidas	166,3	36,5	10,4	109,4	192,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	675,5	660,7	264,8	774,7	440,4
ii. A futuro	98,0	64,5	85,0	107,0	64,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-2,9	-6,0	-38,2	21,2	55,4
i. Compras	115,6	15,0	10,3	103,1	177,2
ii. (-) Ventas	118,6	21,0	48,5	81,9	121,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-165,1	-131,7	0,0	-2,1	-196,4
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6915	2,6909	2,6920	2,6931	2,6901
(*) Datos preliminares					