

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	10 Diciembre	11 Diciembre	12 Diciembre	13 Diciembre	14 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	17 830,6	18 709,8	18 416,2	20 156,0	20 387,7
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 (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	26,0	50,0 50,0	100,0	50,0 50,0	
Plazo de vencimiento	236,7	332,0 145,0	313,3	200,8 175,7	
Tasas de interés	183 d	182 d 366 d	365 d	364 d 364 d	
Mínima	3,82	3,81 3,84	3,85	3,80 3,82	
Máxima	3,82	3,81 3,85	3,87	3,85 3,88	
Promedio	3,82	3,81 3,85	3,85	3,83 3,85	
Saldo	22 415,9	21 665,9	21 765,9	20 104,7	20 104,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Enero de 2013)					300,0
Vencimientos de CD BCRP del 17 al 21 de Diciembre de 2012					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 999,9	5 199,9	5 599,9	6 400,0	6 799,9
Propuestas recibidas	9 479,9	10 113,5	10 054,9	11 274,5	11 393,8
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés	4,10	4,11	4,10	4,03	4,02
Mínima	4,15	4,14	4,13	4,12	4,10
Máxima	4,14	4,13	4,12	4,09	4,06
Promedio	3 999,9	5 199,9	5 599,9	6 400,0	6 799,9
Saldo					6 799,9
Próximo vencimiento de Depósitos (17 de Diciembre de 2012).					6 799,9
Vencimientos de Depósitos del 17 al 21 de Diciembre de 2012					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	154,4	154,3	205,6	205,2	205,1
i. Compras (millones de US\$)	60,0	60,0	80,0	80,0	80,0
Tipo de cambio promedio	2,5728	2,5722	2,5698	2,5653	2,5633
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	13 959,1	13 564,2	12 921,8	13 861,2	13 792,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%	0,0137%	0,0137%	0,0137%	0,0137%
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	0,0	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	13 959,1	13 564,2	12 921,8	13 861,2	13 792,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	18 056,3	17 971,2	18 004,9	18 014,8	17 902,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,6	21,5	21,5	21,5	21,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	14 332,9	14 421,7	14 343,7	14 225,2	14 194,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,1	17,0	17,1	17,1	16,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	612,0	647,0	776,0	337,0	883,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	98,5	122,7	131,7	198,7	186,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	1,00/1,05/1,00	1,00/1,05/1,00	1,00/1,00/1,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	1 665,5	1 676,4	1 705,0	803,9	27,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	100,0 / 3,82		50,0 / 3,81	60,6 / 3,81	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	15,5 / 3,85			8,0 / 3,82	17,0 / 3,85
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	7 Diciembre	10 Diciembre	11 Diciembre	12 Diciembre	13 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	-102,0	48,6	-84,1	10,4	40,0
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f	10,5	9,0	9,0	115,4	-115,2
a. Mercado spot con el público	105,9	71,6	98,7	211,7	55,1
i. Compras	329,8	326,1	394,2	414,7	433,4
ii. (-) Ventas	223,9	254,5	295,5	202,9	378,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	11,1	-54,4	-18,9	-83,0	-7,6
i. Pactadas	96,0	145,6	250,7	78,9	118,5
ii. (-) Vencidas	84,9	200,0	269,6	161,8	126,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	123,5	-94,0	54,3	22,0	-162,8
i. Pactadas	246,8	195,3	166,9	220,1	91,3
ii. (-) Vencidas	123,3	289,3	112,6	198,1	254,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	840,0	1113,4	928,5	1033,0	1608,5
ii. A futuro	75,0	277,0	155,0	90,0	135,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	13,4	83,0	-154,8	23,4	116,2
i. Compras	83,1	233,5	105,4	178,9	232,0
ii. (-) Ventas	69,7	150,5	260,2	155,5	115,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-70,5	-56,3	-91,8	-83,5	-158,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5740	2,5738	2,5720	2,5695	2,5647
(*) Datos preliminares					