

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	21 Diciembre	26 Diciembre	27 Diciembre	28 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	18 860,8	18 849,7	19 086,5	19 965,3
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 (CD BCRP)		100,0	50,0 50,0	50,0
Propuestas recibidas		315,5	193,4 168,4	133,0
Plazo de vencimiento		351 d	350 d 350 d	349 d
Tasas de interés Mínima		3,98	3,90 3,97	3,96
Máxima		4,00	3,99 3,99	3,96
Promedio		4,00	3,94 3,97	3,96
Saldo	20 554,7	20 654,7	20 754,7	20 804,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Enero de 2013)				300,0
Vencimientos de CD BCRP del 2 al 4 de Enero de 2013				0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	9 451,8	9 800,0	10 500,0	9 247,9
Propuestas recibidas	9 451,8	11 915,7	13 043,5	9 247,9
Plazo de vencimiento	5 d	1 d	5 d	5 d
Tasas de interés Mínima	4,04	4,05	4,06	4,00
Máxima	4,25	4,24	4,21	4,24
Promedio	4,15	4,16	4,16	4,13
Saldo	9 451,8	9 800,0	10 500,0	9 247,9
Próximo vencimiento de Depósitos (2 de Enero de 2013)				9 247,9
Vencimientos de Depósitos del 2 al 4 de Enero de 2013				9 247,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	102,5	102,2	203,9	102,0
i. Compras (millones de US\$)	40,0	40,0	80,0	40,0
Tipo de cambio promedio	2,5620	2,5550	2,5485	2,5509
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	9 511,5	9 051,9	8 690,4	10 769,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps), Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0137%	0,0137%	0,0138%	0,0138%
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	30,0	350,0	230,0	495,0
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	9 481,5	8 701,9	8 460,4	10 274,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	17 146,5	16 178,1	16 029,6	16 099,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	20,4	19,3	19,1	19,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	13 218,5	12 469,9	12 469,9	12 391,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,0	14,8	14,7	14,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	382,5	285,5	183,5	359,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,15/4,30/4,25	4,00/4,30/4,21
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	266,2	237,3	115,9	139,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,75/0,95/0,86	0,80/0,95/0,84	0,80/0,85/0,81	0,80/1,80/1,74
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	88,5	140,2	75,5	93,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	10,5 / 3,81			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	30,0 / 3,90	61,5 / 3,81	20,0 / 3,90	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Diciembre	24 Diciembre	26 Diciembre	27 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	77,1	27,1	-221,8	-114,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	42,4	13,9	-227,7	-40,4
a. Operaciones spot con el público	97,4	21,9	-149,1	85,0
i. Compras	453,4	57,0	264,5	425,4
ii. (-) Ventas	356,0	35,1	413,6	340,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-75,4	1,7	-104,2	18,4
i. Pactadas	124,4	5,1	90,9	53,9
ii. (-) Vencidas	199,8	3,3	195,1	35,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-110,1	-11,5	-110,1	92,0
i. Pactadas	43,9	0,1	54,3	292,4
ii. (-) Vencidas	154,0	11,6	164,4	200,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	1040,2	0,0	1060,6	1627,0
ii. A futuro	76,0	0,0	280,0	369,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-59,8	0,2	-68,8	150,5
i. Compras	128,6	0,2	123,0	178,1
ii. (-) Ventas	188,4	0,0	191,7	27,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-41,0	0,0	-40,5	-110,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		2,5631	2,5551	2,5492
(*) Datos preliminares				