

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	16 Abril	17 Abril	18 Abril	19 Abril	20 Abril
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	13 998,0	13 987,2	13 512,7	13 691,4	13 174,7
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	200,0 9,1	100,0 199,9 100,0		100,0	100,0 30,4
Plazo de vencimiento	760,8 171,1	544,8 831,7 417,7		198,4	251,5 130,4
Tasas de interés Mínima	176 d 353 d	175 d 93 d 175 d		350 d	172 d 349 d
Máxima	4,19 4,19	4,18 4,18 4,20		4,20	3,98 4,23
Promedio	4,24 4,25	4,21 4,20 4,21		4,25	4,23 4,25
Saldo	4,19 4,25	4,20 4,19 4,20		4,24	4,21 4,24
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de mayo de 2012)	20 560,6		20 960,5	21 060,5	21 190,9
Vencimientos de CD BCRP del 23 al 27 de abril de 2012	620,0	620,0	620,0	620,0	620,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	6 600,1	6 899,9	6 900,0	3 000,0 4 300,0	4 000,0 3 200,0
Plazo de vencimiento	7 631,4	8 091,6	9 508,8	4 599,9 5 976,6	6 641,1 4 179,9
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Máxima	4,15	4,16	4,16	4,19 4,16	3,50 4,10
Promedio	4,23	4,22	4,21	4,24 4,23	4,23 4,22
Saldo	4,20	4,21	4,20	4,22 4,20	4,21 4,19
Próximo vencimiento de Depósitos (23 de abril de 2012)	6 600,1	6 899,9	6 900,0	7 300,0	7 200,0
Vencimientos de Depósitos del 23 al 27 de abril de 2012			6 900,0		7 200,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	464,9	297,5	430,1	164,5	1 176,4
Tipo de cambio promedio	175,0	112,0	162,0	62,0	444,5
ii. Ventas (millones de US\$)	2,6567	2,6560	2,6548	2,6540	2,6511
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	7 653,7	6 984,9	7 042,8	6 456,0	7 022,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0132%	0,0132%	0,0132%	0,0132%	0,0132%
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	1,2	6,8	67,8	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	7 652,5	6 978,1	6 975,0	6 456,0	7 022,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 682,9	12 682,9	12 682,9	12 682,9	12 796,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	27,3	27,3	27,3	27,3	17,15
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10 236,7	9 628,7	9 472,8	9 472,8	9 350,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19,9	19,9	19,9	19,9	12,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	203,6	322,2	536,1	805,5	441,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,25	4,22/4,25/4,24	4,22/4,25/4,24	4,22/4,25/4,24
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	170,5	327,2	413,8	403,5	432,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,80/1,85/1,84	1,75/1,80/1,79	1,80/1,90/1,84	1,85/1,90/1,88	1,95/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	86,0	0,0	13,3	26,0	12,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			12,0/4,21		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					9,0/4,24
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 Abril	16 Abril	17 Abril	18 Abril	19 Abril
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-85,6	-58,8	93,5	-57,7	-53,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-78,9	-53,1	4,7	13,1	-6,7
a. Mercado spot con el público	113,2	148,1	122,3	186,9	68,2
i. Compras	326,4	353,0	370,8	310,6	265,4
ii. (-) Ventas	213,2	204,9	248,5	123,7	197,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	13,4	-58,1	196,8	-61,8	-8,1
i. Pactadas	59,1	24,6	221,2	60,3	113,7
ii. (-) Vencidas	45,7	82,7	24,4	122,1	121,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	20,0	-52,3	108,1	8,9	38,2
i. Pactadas	73,8	29,4	236,4	184,8	124,5
ii. (-) Vencidas	53,8	81,7	128,3	175,8	86,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	482,2	413,0	380,8	798,3	1146,3
ii. A futuro	108,0	146,0	90,0	85,0	58,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-18,8	-20,5	103,2	48,4	-45,4
i. Compras	21,9	55,4	126,2	168,7	71,1
ii. (-) Ventas	40,6	75,9	23,0	120,4	116,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-165,3	-181,6	-116,9	-168,5	-65,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6573	2,6562	2,6558	2,6542	2,6539
(*) Datos preliminares					