

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	21 enero	22 enero	23 enero	24 enero	25 enero
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>24 257,0</b>	<b>24 256,9</b>	<b>24 008,7</b>	<b>23 500,1</b>	<b>23 628,7</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	100,0	50,0 200,0 100,0	100,0 100,0	50,0 100,0	100,0
Plazo de vencimiento	630,9	427,8 600,3 395,0	483,3 360,0	264,3 221,2	364,1
Tasas de interés	169 d	168 d 168 d 352 d	167 d 351 d	350 d 350 d	349 d
Máxima	3,70	3,74 3,75 3,78	3,75 3,82	3,76 3,79	3,82
Promedio	3,80	3,75 3,79 3,85	3,77 3,85	3,80 3,85	3,85
Saldo	3,77	3,75 3,77 3,81	3,76 3,84	3,79 3,84	3,83
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Febrero de 2013)	21 054,7	21 404,7	21 604,7	21 754,7	21 854,7
Vencimientos de CD BCRP del 28 de Enero al 1 de Febrero de 2013	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0	2 000,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	4 000,0 10 900,0	4 000,0 11 400,0	9 000,0 6 800,0	9 000,0 6 500,0	9 000,0 6 700,0
Plazo de vencimiento	14 482,5 14 256,3	14 259,0 14 437,9	14 495,3 8 744,1	13 796,9 7 829,4	11 943,0 7 396,4
Tasas de interés	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Máxima	3,60 3,50	3,60 3,55	3,61 4,00	4,09 4,05	4,10 4,10
Promedio	3,68 3,71	3,61 3,69	4,18 4,18	4,18 4,17	4,17 4,16
Saldo	3,61 3,63	3,60 3,61	4,06 4,12	4,14 4,15	4,14 4,13
Próximo vencimiento de Depósitos el 28 de Enero 2013	14 900,0	15 400,0	15 800,0	15 500,0	15 700,0
Vencimientos de Depósitos del 28 de Enero al 1 de Febrero de 2013	14 900,0	15 400,0	15 800,0	15 500,0	15 700,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	127,7	127,7	255,3	127,7	127,8
Tipo de cambio promedio	50,0	50,0	100,0	50,0	50,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,5531	2,5543	2,5531	2,5547	2,5568
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>9 384,7</b>	<b>8 634,6</b>	<b>8 264,0</b>	<b>7 977,8</b>	<b>7 956,5</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0138%	0,0138%	0,0138%	0,0138%	0,0138%
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	100,0	1 950,0	0,0	0,0	100,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>9 284,7</b>	<b>6 684,6</b>	<b>8 264,0</b>	<b>7 977,8</b>	<b>7 856,5</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	20 117,8	20 117,8	20 117,8	20 117,8	17 882,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	23,5	23,5	23,5	23,5	20,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	15 701,6	14 831,2	14 460,9	14 191,5	13 938,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,9	18,9	18,9	18,9	16,2
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	136,0	332,0	220,0	185,0	150,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,60/4,00/3,69	3,70/3,90/3,83	4,10/4,20/4,14	4,10/4,20/4,17	4,10/4,20/4,19
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	73,2	67,5	210,2	302,9	181,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,00/5,50/5,00	5,00/5,00/5,00	5,00/5,05/5,01	5,00/5,05/5,00	4,00/5,05/4,97
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	20,0	115,0	91,7	161,7	128,7
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)		39,9 / 3,75	40,0 / 3,79	106,7 / 3,78	5,9 / 4,18
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			40,0 / 3,78	25,0 / 3,80	46,3 / 3,87
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>18 Enero</b>	<b>21 Enero</b>	<b>22 Enero</b>	<b>23 Enero</b>	<b>24 Enero</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	39,4	-47,6	190,5	-102,0	-125,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	189,3	-51,9	53,1	-91,5	30,2
a. Mercado spot con el público	192,9	-5,4	136,6	34,1	120,1
i. Compras	451,1	263,1	360,8	303,6	403,3
ii. (-) Ventas	258,2	268,4	224,2	269,4	283,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	97,2	31,6	218,9	90,2	-86,8
i. Pactadas	175,8	43,8	363,7	189,1	147,1
ii. (-) Vencidas	78,6	12,2	144,8	98,9	234,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	247,1	27,3	81,5	100,8	69,1
i. Pactadas	413,5	28,6	238,9	218,5	233,5
ii. (-) Vencidas	166,4	1,3	157,4	117,8	164,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1 178,0	699,0	1 132,0	872,4	505,5
ii. A futuro	93,0	90,0	305,0	447,0	209,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	103,4	-6,7	-12,9	-5,7	-109,5
i. Compras	166,0	0,7	130,7	91,1	117,2
ii. (-) Ventas	62,6	7,4	143,6	96,8	226,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-19,2	-50,8	-58,0	-101,0	-50,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5547	2,5519	2,5542	2,5526	2,5547
(*) Datos preliminares					