

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	28 enero	29 enero	30 enero	31 enero	1 febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	23 841,8	24 273,6	24 008,0	24 613,9	23 153,9
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	100,0	50,0 50,0 100,0	50,0 100,0	100,0 50,0	100,0
Plazo de vencimiento	377,2	276,8 160,0 333,8	215,5 413,0	264,9 204,0	304,0
Tasas de interés Mínima	346 d	161 d 161 d 345 d	160 d 344 d	159 d 343 d	158 d
Máxima	3,81	3,75 3,77 3,80	3,76 3,79	3,76 3,79	3,77
Promedio	3,84	3,79 3,81 3,80	3,76 3,80	3,79 3,79	3,80
Saldo	3,83	3,77 3,78 3,80	3,76 3,79	3,79 3,79	3,80
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Febrero de 2013)	21 954,7	22 154,7	22 304,7	22 454,7	22 554,7
Vencimientos de CD BCRP el 1 de Febrero de 2013					2 000,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					2 000,0
Propuestas recibidas	9 000,0 6 354,5	9 000,1 6 900,0	6 041,3 9 499,9	9 000,0 5 307,7	5 307,7
Plazo de vencimiento	12 322,2 6 354,5	12 721,6 7 790,9	6 041,3 10 193,9	11 312,6 5 307,7	5 307,7
Tasas de interés Mínima	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d
Máxima	4,13 4,10	4,12 4,12	4,13 4,10	4,15 4,00	4,00
Promedio	4,17 4,25	4,19 4,25	4,25 4,24	4,22 4,21	4,21
Saldo	4,15 4,14	4,16 4,19	4,18 4,18	4,18 4,16	4,16
Próximo vencimiento de Depósitos el 1 de Febrero 2013	15 354,5	15 900,1	15 541,3	14 307,7	0,0
Vencimientos de Depósitos el 1 de Febrero de 2013	15 354,5	15 900,1			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	25,6	25,6	25,7	0,0	411,2
Tipo de cambio promedio	10,0	10,0	10,0		160,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,5610	2,5630	2,5670		2,5698
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	-100,0	-100,0	-100,0	-100,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	100,0	100,0	100,0	100,0	0,0
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	8 413,1	8 199,1	8 342,5	10 156,2	23 465,1
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%	0,0137%	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	66,0	0,0	195,0	401,5
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	8 413,1	8 133,1	8 342,5	9 961,2	23 063,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	20 117,8	20 117,8	20 117,8	20 117,8	27 008,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	23,5	23,5	23,5	23,5	9,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	13 689,5	13 084,4	12 913,7	12 761,3	23 063,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,9	18,9	18,9	18,9	79,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	159,0	105,0	388,0	62,0	369,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,20/4,25/4,22	4,20/4,25/4,21	4,10/4,25/4,23	4,20/4,25/4,22	4,05/4,15/4,09
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	285,3	376,7	340,8	49,0	18,5
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	5,00/5,05/5,00	5,00/5,05/5,00	2,90/5,05/4,90	4,50/5,00/4,95	6,00/6,00/6,00
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)	85,0	84,1	40,0	192,0	33,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	25,0 / 3,82	45,2 / 3,81		130,0 / 3,78	29,0 / 3,80
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	20,0 / 3,82	5,0 / 3,82			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	25 Enero	28 Enero	29 Enero	30 Enero	31 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	6,0	21,4	-27,2	-14,8	245,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	49,4	84,0	-18,5	-1,9	274,0
a. Mercado spot con el público	113,6	115,7	12,2	6,6	306,4
i. Compras	351,1	375,7	313,0	352,5	661,4
ii. (-) Ventas	237,5	260,0	300,8	346,0	355,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	16,0	24,7	96,2	110,4	-23,0
i. Pactadas	240,3	115,9	214,4	205,9	263,3
ii. (-) Vencidas	224,4	91,2	118,2	95,5	286,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	59,4	87,3	104,9	123,3	5,7
i. Pactadas	135,1	210,8	125,2	164,1	342,4
ii. (-) Vencidas	75,7	123,5	20,3	40,8	336,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1 324,4	711,3	639,2	1 447,1	1 265,0
ii. A futuro	128,0	316,0	235,0	145,0	80,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-157,7	21,9	-101,0	-44,6	41,7
i. Compras	60,2	106,5	14,9	35,5	324,0
ii. (-) Ventas	217,9	84,6	115,9	80,1	282,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-55,2	-21,3	-27,6	-18,5	-23,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5566	2,5602	2,5626	2,5601	2,5813
(*) Datos preliminares					