

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	25 febrero	26 febrero	27 febrero	28 febrero	1 Marzo
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>26 778,5</b>	<b>27 300,0</b>	<b>27 430,9</b>	<b>27 269,6</b>	<b>25 945,6</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	100,0	50,0	Desierta
Plazo de vencimiento	365,5	442,0	359,5	221,0	100,0
Tasas de interés: Mínima	169 d	168 d	345 d	343 d	343 d
Máxima	3,70	3,65	3,70	3,67	-,-
Promedio	3,94	3,70	3,75	3,67	-,-
Saldo	3,79	3,68	3,73	3,67	-,-
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Marzo de 2013)	<u>23 564,7</u>	<u>23 714,7</u>	<u>23 814,7</u>	<u>23 864,7</u>	<u>23 864,7</u>
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 8 de Marzo de 2013					2 300,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo USD)					2 300,1
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de Repo del 27 de Febrero al 01 de Marzo de 2013					
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	10 000,1	6 395,2	10 000,1	6 300,1	9 999,9
Propuestas recibidas	12 728,0	6 395,2	12 677,0	6 743,9	12 894,5
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	4,18	4,17	4,19	4,19	4,20
Máxima	4,24	4,25	4,24	4,25	4,25
Promedio	4,22	4,22	4,23	4,23	4,24
Saldo	<u>16 395,3</u>	<u>16 300,2</u>	<u>16 299,9</u>	<u>12 335,5</u>	<u>2 500,0</u>
Próximo vencimiento de Depósitos (4 de Marzo de 2013)					2 500,0
Vencimientos de Depósitos del 4 al 8 de marzo de 2013					2 500,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	25,8	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	10,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	2,5840				
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	-100,0	-50,0	0,0	8,3
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					8,3
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		100,0	50,0		
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>10 309,0</b>	<b>10 849,8</b>	<b>11 031,0</b>	<b>14 884,1</b>	<b>23 445,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%	0,0136%	0,0136%	0,0136%	0,0135%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	0,0	0,0	0,0	128,0	0,0
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>10 309,0</b>	<b>10 849,8</b>	<b>11 031,0</b>	<b>14 756,1</b>	<b>23 445,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	18 228,4	18 412,3	17 955,0	17 984,2	27 751,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	20,3	20,5	19,9	19,9	93,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	14 237,4	13 750,5	13 638,9	13 542,3	23 445,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,5	15,7	15,2	15,2	79,4
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	338,0	627,0	1 057,8	461,9	488,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,26	4,20/4,30/4,26	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,24
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	165,8	111,2	62,7	15,0	36,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,95/5,00/4,99	1,80/3,50/2,82	0,90/1,00/0,99	1,00/1,00/1,00	4,95/6,05/5,68
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	0,0	280,0	197,7	40,0	58,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		60,0 / 3,70	2,5 / 3,67	40,0 / 3,65	32,0 / 3,62
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		50,0 / 3,75	50,0 / 3,70		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>22 Febrero</b>	<b>25 Febrero</b>	<b>26 Febrero</b>	<b>27 Febrero</b>	<b>28 Febrero</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-257,0	-16,1	86,6	-48,7	79,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	427,3	-394,5	2,0	42,1	134,6
a. <u> Mercado spot con el público</u>	37,1	38,1	-5,9	62,5	142,5
i. Compras	364,1	395,9	400,6	352,1	499,9
ii. (-) Ventas	326,9	357,8	406,5	289,6	357,4
b. <u> Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	41,7	-9,7	-50,5	-53,0	5,5
i. Pactadas	98,1	179,6	251,6	135,1	127,4
ii. (-) Vencidas	56,4	189,4	302,1	188,0	121,8
c. <u> Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	726,0	-388,1	-135,1	37,8	60,3
i. Pactadas	752,9	114,0	305,8	192,3	308,4
ii. (-) Vencidas	26,9	502,1	440,9	154,4	248,1
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	1 297,4	1 142,9	1 270,8	609,9	554,6
ii. A futuro	178,0	40,0	76,0	119,0	18,0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	379,8	-110,3	147,2	-53,7	124,6
i. Compras	402,6	74,0	436,1	120,1	237,2
ii. (-) Ventas	22,9	184,3	288,9	173,8	112,5
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-19,1	-9,5	-0,6	-0,3	-6,2
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5818	2,5825	2,5830	2,5800	2,5871
(*) Datos preliminares					