BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	18 Marzo	19 Marzo		20 Marzo	21 Marzo		22 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	**26 283,2**	**26 327,3**		**25 979,0**	**25 644,2**		**25 164,6**
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	100,0	100,0	50,0	50,0	
Propuestas recibidas	300,0	280,0	225,0	220,0	277,0	201,5	
Plazo de vencimiento	176 d	175 d	175 d	174 d	357 d	357 d	
Tasas de interés Mínima	3,80	3,76	3,81	3,81	3,81	3,83	
Máxima	3,81	3,81	3,81	3,81	3,84	3,87	
Promedio	3,81	3,77	3,81	3,81	3,83	3,86	
Saldo	22 734,6	22 884,6		22 984,6	23 084,6		23 084,6
Próximo vencimiento de CD BCRP (4 de Abril de 2013)							559,5
Vencimientos de CD BCRP del 25 al 27 de Marzo de 2013							0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	15 399,9	15 900,0		16 400,0	16 300,0		15 500,1
Propuestas recibidas	17 847,0	19 634,4		18 250,8	16 875,6		17 047,1
Plazo de vencimiento	1 d	1 d		1 d	1 d		3 d
Tasas de interés Mínima	4,00	4,00		4,00	4,00		3,99
Máxima	4,09	4,08		4,08	4,08		4,08
Promedio	4,05	4,05		4,05	4,05		4,04
Saldo	15 399,9	15 900,0		16 400,0	16 300,0		15 500,1
Próximo vencimiento de Depósitos (25 de Marzo de 2013)							15 500,1
Vencimientos de Depositos del 25 al 27 de Marzo de 2013							15 500,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	51,9	51,9		103,7	51,8		181,4
i. Compras (millones de US$)	20,0	20,0		40,0	20,0		70,0
Tipo de cambio promedio	2,5974	2,5951		2,5931	2,5924		2,5910
ii. Ventas (millones de US$)							
Tipo de cambio promedio							
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0,0	0,0		-100,0	-100,0		-100,0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público							
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público				100,0	100,0		100,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0		0,0	0,0		0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR							
ii. Compras de BTP							
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**10 835,2**	**10 329,2**		**9 582,7**	**9 296,0**		**9 845,9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones							
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).							
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0135%		0,0135%	0,0135%		0,0136%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)							
Tasa de interés	5,05%	5,05%		5,05%	5,05%		5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional							
Tasa de interés	5,05%	5,05%		5,05%	5,05%		5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5,0	10,0		55,0	5,0		4,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%		3,45%	3,45%		3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**10 830,2**	**10 319,2**		**9 527,7**	**9 291,0**		**9 841,9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	21 452,0	21 737,9		20 734,4	20 398,4		20 092,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	23,2	23,5		22,4	22,1		21,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	18 196,3	17 159,8		16 799,7	16 436,1		16 136,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,9	19,3		18,2	17,8		17,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP							
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	233,7	348,7		452,2	373,7		118,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,15/4,30/4,24	4,15/4,30/4,22		4,20/4,25/4,24	4,15/4,30/4,24		4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	75,7	228,6		283,0	117,5		97,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,00/1,50/1,04	1,00/1,00/1,00		0,80/1,00/0,97	0,70/0,80/0,79		0,10/0,70/0,61
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,5	91,6		27,0	0,8		17,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		19,8 / 3,82		10,0 / 3,75			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)							15,0 / 3,80
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)							
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**15 Marzo**	**18 Marzo**		**19 Marzo**	**20 Marzo**		**21 Marzo**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	**-66,9**	**71,9**		**-21,3**	**36,9**		**92,8**
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	**-15,4**	**53,0**		**39,7**	**-50,6**		**52,1**
a. Mercado spot con el público	**109,7**	**106,5**		**53,0**	**22,2**		**78,5**
i. Compras	290,0	346,1		290,4	278,2		429,9
ii. (-) Ventas	180,2	239,6		237,4	256,0		351,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	**-33,7**	**-41,9**		**137,3**	**103,4**		**128,8**
i. Pactadas	189,1	103,6		284,8	222,4		240,5
ii. (-) Vencidas	222,8	145,5		147,5	119,0		111,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	**17,8**	**-60,9**		**198,3**	**15,8**		**88,1**
i. Pactadas	142,5	82,3		298,0	214,9		236,6
ii. (-) Vencidas	124,7	143,2		99,7	199,1		148,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias							
i. Al contado	706,6	967,6		1 418,7	1 175,3		1 256,9
ii. A futuro	125,0	240,0		273,0	135,0		236,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	**-123,1**	**-35,9**		**-41,2**	**47,2**		**30,4**
i. Compras	76,5	103,3		81,9	155,2		135,7
ii. (-) Ventas	199,6	139,1		123,1	108,0		105,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	**-100,2**	**-20,0**		**-20,0**	**-40,0**		**-20,0**
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera							
Tasa de interés							
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5925	2,5983		2,5954	2,5928		2,5933
(*) Datos preliminares							

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera