

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	25 Marzo	26 Marzo	27 Marzo
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>25 561,1</b>	<b>25 362,4</b>	<b>25 709,3</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)	50,0      50,0	50,1      50,0	50,0
Propuestas recibidas	236,0      180,0	219,8      173,5	166,0
Plazo de vencimiento	80 d      169 d	168 d      261 d	78 d
Tasas de interés	3,70      3,78	3,72      3,75	3,72
Mínima	3,74      3,79	3,78      3,77	3,83
Máxima	3,72      3,79	3,76      3,77	3,82
Promedio	3,72      3,79	3,76      3,77	3,82
Saldo	<u>23 184,6</u>	<u>23 284,7</u>	<u>23 334,7</u>
Próximo vencimiento de CD BCRP (4 de Abril de 2013)			559,5
Vencimientos de CD BCRP el 27 de Marzo de 2013			559,5
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	15 200,0	14 500,0	12 700,1
Propuestas recibidas	15 853,4	16 083,6	13 713,7
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	5 d
Tasas de interés	4,00	3,99	3,99
Mínima	4,09	4,15	4,10
Máxima	4,06	4,05	4,04
Promedio	4,06	4,05	4,04
Saldo	<u>15 200,0</u>	<u>14 500,0</u>	<u>12 700,1</u>
Próximo vencimiento de Depósitos (27 de Marzo de 2013)			12 700,1
Vencimientos de Depósitos el 27 de Marzo de 2013			12 700,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	310,3	310,2	414,4
i. Compras (millones de US\$)	120,0	120,0	160,0
Tipo de cambio promedio	2,5859	2,5854	2,5900
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	-100,0	0,0	-100,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público			
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	100,0		100,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	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>10 571,4</b>	<b>11 072,5</b>	<b>13 373,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%	0,0136%	0,0136%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional			
Tasa de interés	4,0	5,0	1 121,0
Tasa de interés	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>10 567,4</b>	<b>11 067,5</b>	<b>12 252,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 330,6	19 585,4	18 972,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	20,9	21,2	20,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	15 811,6	15 124,3	15 017,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,7	16,9	16,3
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	281,5	634,3	661,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,24	4,20/4,30/4,25	4,20/4,25/4,24
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	107,0	89,9	55,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,10/0,30/0,23	0,20/0,30/0,28	0,30/0,50/0,34
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	13,0	64,9	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	13,0 / 3,81		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>22 Marzo</b>	<b>25 Marzo</b>	<b>26 Marzo</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-30,8	-95,3	15,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-59,4	-213,6	-42,8
a. Mercado spot con el público	49,6	-20,3	108,9
i. Compras	292,9	271,7	437,3
ii. (-) Ventas	243,4	292,1	328,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-0,3	-76,5	71,6
i. Pactadas	221,6	119,8	153,5
ii. (-) Vencidas	222,0	196,3	82,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-28,9	-194,8	13,7
i. Pactadas	164,1	191,8	182,7
ii. (-) Vencidas	193,1	386,6	168,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	1 346,1	890,8	883,7
ii. A futuro	424,0	140,0	80,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-62,5	117,1	57,6
i. Compras	150,9	306,5	119,1
ii. (-) Ventas	213,5	189,4	61,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-75,4	-120,1	-122,4
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5904	2,5869	2,5848
(*) Datos preliminares			