

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

| | 27 Febrero | 28 Febrero | 29 Febrero | 1 Marzo | 2 Marzo |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 12 302,9 | 12 381,3 | 12 769,3 | 12 314,3 | 12 736,9 |
| 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 | 200,0 | 100,0 100,0 | 200,0 | 100,0 | 100,0 200,0 |
| Plazo de vencimiento | 640,0 | 404,0 234,0 | 527,0 | 322,7 | 160,0 475,6 |
| Tasas de interés Mínima | 3,98 | 196 d 373 d | 372 d | 371 d | 286 d 370 d |
| Máxima | 3,98 | 3,95 3,98 | 3,98 | 3,97 | 4,05 3,99 |
| Promedio | 3,98 | 4,00 3,98 | 3,98 | 4,00 | 4,05 4,05 |
| Saldo | 18 670,0 | 18 870,0 | 19 070,0 | 19 170,0 | 19 470,0 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de marzo de 2012) | 1 150,0 | 1 150,0 | 1 150,0 | 1 150,0 | 1 150,0 |
| Vencimientos de CD BCRP del 5 al 9 de marzo de 2012 | | | | | 0,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | 7 000,0 | 6 578,0 | 6 788,4 | 2 900,0 | 3 200,1 |
| Propuestas recibidas | 7 234,4 | 6 578,0 | 6 788,4 | 3 179,4 | 5 417,8 |
| Plazo de vencimiento | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | 3 d |
| Tasas de interés Mínima | 4,18 | 4,15 | 4,19 | 4,10 | 4,15 |
| Máxima | 4,25 | 4,25 | 4,25 | 4,25 | 4,25 |
| Promedio | 4,23 | 4,23 | 4,23 | 4,23 | 4,24 |
| Saldo | 7 000,0 | 6 578,0 | 6 788,4 | 2 900,0 | 3 200,1 |
| Próximo vencimiento de Depósitos (5 de marzo de 2012) | | | | | 3 200,1 |
| Vencimientos de Depósitos del 5 al 9 de marzo de 2012 | | | | | 3 200,1 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 203,5 | 195,5 | 315,7 | 369,2 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) | 76,0 | 73,0 | 118,0 | 138,0 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | 2,6780 | 2,6783 | 2,6754 | 2,6753 | |
| ii. Ventas (millones de US\$) | 127,5 | 122,5 | 197,7 | 231,2 | 0,0 |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Compras de BTP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 5 306,5 | 5 798,8 | 6 096,6 | 9 683,5 | 9 236,8 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0131% | 0,0131% | 0,0131% | 0,0131% | 0,0131% |
| 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 | | | | | |
| Tasa de interés | 0,0 | 0,0 | 73,5 | 0,0 | 0,0 |
| | 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 | 5 306,5 | 5 798,8 | 6 023,1 | 9 683,5 | 9 236,8 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 10 292,6 | 10 255,1 | 10 264,2 | 13 129,6 | 12 906,2 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 14,6 | 14,5 | 14,5 | 64,0 | 27,6 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 6 846,5 | 6 846,5 | 6 818,1 | 9 683,5 | 9 460,1 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,7 | 9,7 | 9,7 | 47,2 | 20,4 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 693,0 | 891,0 | 721,6 | 872,7 | 771,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,25/4,25/4,25 | 4,20/4,25/4,25 | 4,25/4,25/4,25 | 4,20/4,25/4,25 | 4,20/4,25/4,25 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 105,1 | 52,0 | 0,0 | 96,0 | 99,8 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,00/1,30/1,12 | 0,95/1,00/1,00 | | 2,30/2,70/2,57 | 2,50/3,00/2,78 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 0,0 | 4,0 | 0,0 | 105,0 | 15,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | 4,0/3,99 | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 24 Febrero | 27 Febrero | 28 Febrero | 29 Febrero | 1 Marzo |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 68,1 | -9,5 | 62,2 | -29,6 | -103,4 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 112,3 | 101,0 | 101,1 | -52,2 | -94,5 |
| a. Mercado spot con el público | 176,6 | 153,5 | 177,0 | 76,1 | 50,0 |
| i. Compras | 370,0 | 361,6 | 394,9 | 354,0 | 259,0 |
| ii. (-) Ventas | 193,4 | 208,1 | 217,9 | 277,8 | 209,0 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -12,4 | -26,6 | 36,6 | 20,3 | 25,8 |
| i. Pactadas | 126,2 | 91,3 | 81,7 | 80,6 | 127,2 |
| ii. (-) Vencidas | 138,6 | 118,0 | 45,2 | 60,3 | 101,4 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 31,9 | 83,9 | 75,4 | -2,3 | 34,7 |
| i. Pactadas | 134,5 | 138,7 | 138,1 | 108,4 | 115,2 |
| ii. (-) Vencidas | 102,7 | 54,8 | 62,7 | 110,7 | 80,5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 244,9 | 390,1 | 383,0 | 410,2 | 210,0 |
| ii. A futuro | 75,5 | 72,0 | 110,0 | 87,0 | 63,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -78,1 | -60,4 | 14,2 | 50,1 | -32,3 |
| i. Compras | 4,4 | 51,9 | 55,3 | 108,5 | 64,1 |
| ii. (-) Ventas | 82,4 | 112,4 | 41,1 | 58,4 | 97,0 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -22,1 | -57,2 | -72,6 | -128,0 | -132,5 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,6789 | 2,6780 | 2,6780 | 2,6764 | 2,6750 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |