

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	8 febrero	12 febrero	13 febrero	14 febrero	15 febrero
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>29 021,2</b>	<b>28 876,9</b>	<b>28 422,5</b>	<b>28 128,4</b>	<b>28 375,6</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas	200,0 50,0	50,0 100,0 100,0	200,0	50,0 100,0 200,0	200,0 100,0
Plazo de vencimiento	420,0 120,0	292,0 515,0 280,0	769,7	275,0 366,0 659,9	690,0 193,5
Tasas de interés	363 d 545 d	182 d 182 d 359 d	181 d	357 d 357 d 180 d	179 d 356 d
Mínima	3,75 3,79	3,66 3,68 3,74	3,67	3,70 3,71 3,67	3,65 3,67
Máxima	3,79 3,79	3,73 3,70 3,76	3,71	3,72 3,71 3,70	3,69 3,70
Promedio	3,78 3,79	3,69 3,69 3,76	3,70	3,71 3,71 3,70	3,67 3,67
Saldo	21 604,7	21 454,7	21 654,7	22 004,7	22 304,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Marzo de 2013)					2 300,1
Vencimientos de CD BCRP del 18 al 22 de Febrero de 2013					0,0
<b>ii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>					
Propuestas recibidas	5 000,0 9 500,0	5 000,1 10 500,0	5 000,0 11 300,0	5 000,0 12 200,1	5 000,0 13 000,0
Plazo de vencimiento	8 581,0 13 393,2	11 965,0 11 271,5	12 621,0 11 700,4	9 813,0 13 019,0	11 781,3 13 366,9
Tasas de interés	4 d 4 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Mínima	4,02 4,00	4,05 4,03	4,05 4,00	4,05 4,03	4,05 4,03
Máxima	4,09 4,08	4,08 4,11	4,07 4,13	4,08 4,13	4,08 4,13
Promedio	4,07 4,05	4,07 4,06	4,06 4,07	4,06 4,08	4,06 4,07
Saldo	14 500,0	15 500,1	16 300,0	17 200,1	18 000,0
Próximo vencimiento de Depósitos del 18 de Febrero de 2013					18 000,0
Vencimientos de Depósitos del 18 al 22 de Febrero de 2013					18 000,0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
i. Compras (millones de US\$)	51,6	154,5	308,3	718,7	539,8
Tipo de cambio promedio	20,0	60,0	120,0	280,0	210,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,5787	2,5743	2,5694	2,5689	2,5707
Tipo de cambio promedio					
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	-100,0	0,0	-100,0	-100,0	-100,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	100,0	0,0	100,0	100,0	100,0
ii. Compras de BTP	0,0		0,0	0,0	0,0
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>14 322,8</b>	<b>13 281,3</b>	<b>12 230,8</b>	<b>11 297,0</b>	<b>10 615,4</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</b>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%	0,0136%	0,0137%	0,0137%	0,0137%
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
<b>c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
<b>d. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	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>14 322,8</b>	<b>13 281,3</b>	<b>12 230,8</b>	<b>11 297,0</b>	<b>10 615,4</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	<b>23 827,1</b>	<b>21 556,4</b>	<b>21 503,3</b>	<b>21 137,8</b>	<b>20 759,8</b>
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>26,9</b>	<b>24,0</b>	<b>23,9</b>	<b>23,5</b>	<b>23,1</b>
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	<b>18 845,3</b>	<b>17 611,8</b>	<b>17 258,2</b>	<b>16 871,5</b>	<b>16 454,4</b>
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>22,0</b>	<b>19,2</b>	<b>19,1</b>	<b>18,7</b>	<b>18,3</b>
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	95,0	185,0	210,0	415,0	184,0
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,20/4,20	4,15/4,20/4,19	4,15/4,20/4,18	4,15/4,25/4,20	4,12/4,20/4,20
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)	213,7	232,0	282,7	370,1	206,5
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	4,45/5,00/4,72	3,50/4,05/3,98	2,00/3,50/3,41	1,50/2,00/1,98	2,00/2,52/2,01
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	97,0	60,0	20,0	223,4	82,4
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)	8,0 / 3,68	30,0 / 3,68	10,0 / 3,70	130,0 / 3,69	67,4 / 3,70
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	55,0 / 3,75		10,0 / 3,75	14,0 / 3,70	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>8 Febrero</b>	<b>11 Febrero</b>	<b>12 Febrero</b>	<b>13 Febrero</b>	<b>14 Febrero</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-115,7	122,8	29,7	-52,1	23,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	197,1	16,1	-16,9	-210,1	-231,3
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>98,0</b>	<b>53,3</b>	<b>33,1</b>	<b>-30,4</b>	<b>112,8</b>
i. Compras	386,4	112,9	475,1	346,9	384,1
(-) Ventas	288,4	59,6	441,9	377,3	271,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-31,3	-40,6	-142,6	56,8	-47,5
i. Pactadas	201,7	-0,3	355,4	261,0	359,0
(-) Vencidas	233,0	40,3	212,8	204,2	406,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<b>281,5</b>	<b>-147,3</b>	<b>96,0</b>	<b>-101,2</b>	<b>-302,5</b>
i. Pactadas	435,8	5,0	284,0	159,7	51,6
(-) Vencidas	154,3	152,3	188,0	260,9	354,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	900,7	0,0	1 286,6	1 248,4	1 131,2
A futuro	214,0	5,0	338,0	229,5	32,1
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<b>44,4</b>	<b>74,8</b>	<b>-14,3</b>	<b>-2,8</b>	<b>-111,8</b>
i. Compras	120,2	111,5	160,1	163,9	287,9
(-) Ventas	75,8	36,6	174,4	166,7	399,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<b>-24,0</b>	<b>0,0</b>	<b>-60,6</b>	<b>-120,3</b>	<b>-284,6</b>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5793		2,5779	2,5706	2,5670
(*) Datos preliminares					