

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	18 febrero	19 febrero	20 febrero	21 febrero
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>28 521,3</b>	<b>27 773,2</b>	<b>27 355,6</b>	<b>27 278,3</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>	<b>200,0</b>	<b>50,0</b>	<b>50,0</b>	<b>100,0</b>
Propuestas recibidas	750,2	208,0	230,8	381,8
Plazo de vencimiento	176 d	535 d	175 d	534 d
Tasas de interés	3,60	3,68	3,68	3,68
Mínima	3,70	3,70	3,69	3,69
Máxima	3,69	3,69	3,68	3,75
Promedio	3,69	3,69	3,68	3,75
Saldo	22 554,7	22 804,7	23 024,7	23 274,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Marzo de 2013)				2 300,1
Vencimientos de CD BCRP el 22 de Febrero de 2013				0,0
<b>v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>	<b>4 999,9</b>	<b>13 300,0</b>	<b>5 000,0</b>	<b>12 400,0</b>
Propuestas recibidas	13 101,0	13 800,4	13 832,1	12 566,4
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés	4,05	4,04	4,04	4,01
Mínima	4,07	4,14	4,07	4,17
Máxima	4,06	4,09	4,06	4,11
Promedio	4,06	4,09	4,06	4,11
Saldo	18 299,9	17 400,0	17 000,0	16 700,1
Próximo vencimiento de Depósitos el 22 de Febrero de 2013				16 700,1
Vencimientos de Depósitos el 22 de Febrero de 2013				16 700,1
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR</b>	<b>51,6</b>	<b>25,8</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>	<b>20,0</b>	<b>10,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
Tipo de cambio promedio	2,5783	2,5820		
<b>ii. Ventas (millones de US\$)</b>	<b>0,0</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
Tipo de cambio promedio				
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>	<b>0,0</b>	<b>-100,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<b>i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</b>	<b>0,0</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<b>ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<b>i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</b>				
<b>ii. Compras de BTP</b>				
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>10 023,0</b>	<b>10 149,0</b>	<b>10 135,6</b>	<b>10 328,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps), Comisión (tasa efectiva diaria)</b>	<b>0,0136%</b>	<b>0,0136%</b>	<b>0,0136%</b>	<b>0,0136%</b>
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>				
Tasa de interés	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%
<b>d. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
Tasa de interés	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>10 023,0</b>	<b>10 149,0</b>	<b>10 135,6</b>	<b>10 328,2</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	<b>19 769,5</b>	<b>20 075,9</b>	<b>19 193,9</b>	<b>18 964,7</b>
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>22,0</b>	<b>22,3</b>	<b>21,3</b>	<b>21,1</b>
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	<b>16 082,8</b>	<b>15 138,6</b>	<b>14 876,0</b>	<b>14 659,5</b>
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>17,2</b>	<b>17,5</b>	<b>16,5</b>	<b>16,3</b>
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>	<b>488,3</b>	<b>356,0</b>	<b>331,0</b>	<b>129,0</b>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,05/4,20/4,14	4,05/4,20/4,19	4,20/4,20/4,20	4,25/4,25/4,25
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	<b>197,4</b>	<b>42,4</b>	<b>29,4</b>	<b>65,9</b>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/3,00/2,39	5,00/6,00/5,71	5,00/7,00/6,83	8,00/9,05/8,88
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>	<b>145,0</b>	<b>79,6</b>	<b>62,0</b>	<b>25,0</b>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	55,0 / 3,62	79,6 / 3,67	10,0 / 3,68	20,0 / 3,67
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	50,0 / 3,66			5,0 / 3,68
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>15 Febrero</b>	<b>18 Febrero</b>	<b>19 Febrero</b>	<b>20 Febrero</b>
Flujo de la posición global = a + b.I - c.I + e + f	-15,7	14,5	126,4	-64,5
Flujo de la posición contable = a + b.II - c.II + e + f	-149,4	35,6	109,9	149,9
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>81,6</b>	<b>89,3</b>	<b>113,1</b>	<b>138,5</b>
<b>i. Compras</b>	<b>403,2</b>	<b>274,3</b>	<b>329,3</b>	<b>414,2</b>
<b>ii. (-) Ventas</b>	<b>321,6</b>	<b>194,0</b>	<b>216,2</b>	<b>275,7</b>
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>99,0</b>	<b>-15,6</b>	<b>114,6</b>	<b>-39,6</b>
<b>i. Pactadas</b>	<b>236,4</b>	<b>15,2</b>	<b>282,5</b>	<b>188,7</b>
<b>ii. (-) Vencidas</b>	<b>137,4</b>	<b>30,7</b>	<b>167,9</b>	<b>228,3</b>
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>-34,8</b>	<b>5,6</b>	<b>97,2</b>	<b>174,7</b>
<b>i. Pactadas</b>	<b>30,7</b>	<b>40,0</b>	<b>139,7</b>	<b>257,4</b>
<b>ii. (-) Vencidas</b>	<b>65,5</b>	<b>34,4</b>	<b>42,5</b>	<b>82,7</b>
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>				
<b>i. Al contado</b>	<b>1 460,2</b>	<b>647,9</b>	<b>1 185,7</b>	<b>1 642,0</b>
<b>ii. A futuro</b>	<b>135,0</b>	<b>70,0</b>	<b>65,0</b>	<b>251,0</b>
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>	<b>-92,5</b>	<b>-21,5</b>	<b>-120,0</b>	<b>-142,1</b>
<b>i. Compras</b>	<b>24,0</b>	<b>0,0</b>	<b>30,2</b>	<b>67,5</b>
<b>ii. (-) Ventas</b>	<b>116,5</b>	<b>21,5</b>	<b>150,2</b>	<b>209,6</b>
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	<b>-210,4</b>	<b>-19,6</b>	<b>-9,6</b>	<b>7,9</b>
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5702	2,5756	2,5831	2,5829
(*) Datos preliminares				