

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Miliones de Nuevos Soles)

	15 Marzo 4 050,2			16 Marzo 3 408,1			17 Marzo 3 403,9			18 Marzo 3 106,2			19 Marzo 2 719,1						
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR																			
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 (CDBCRP)																			
Propuestas recibidas	1 500,3	300,0	400,0	1 194,7	1 499,9	400,0	250,0	890,0	1 500,2	200,0	300,0	1 066,3	1 499,9	300,0	723,6	1 199,9	350,0	550,0	
Plazo de vencimiento	1 561,7	405,0	618,3	1 194,7	1 684,6	632,0	660,7	890,0	1 686,4	418,0	556,3	1 066,3	1 699,9	517,0	723,6	1 510,0	504,0	757,5	
Tasas de inte Mínima	1,20	1,40	1,24	1,20	1,16	1,18	1,25	1,20	1,20	1,42	1,27	1,16	1,20	1,41	1,20	1,20	1,43	1,20	
Máxima	1,23	1,40	1,28	1,23	1,23	1,43	1,28	1,23	1,23	1,42	1,29	1,23	1,23	1,44	1,23	1,24	1,44	1,24	
Promedio	1,23	1,40	1,27	1,23	1,23	1,43	1,28	1,23	1,23	1,42	1,28	1,22	1,23	1,44	1,22	1,23	1,44	1,21	
Saldo	21 632,5				21 977,4				21 804,0				21 761,0				21 637,4		
Próximo vencimiento de CD BCRP (22 de marzo del 2010)													2 223,5				1 749,9		
Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de marzo del 2010													2 223,5				1 849,9		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																			
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0		
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)																			
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0		
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional																			
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0		
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)																			
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0		
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera																			
Saldo	259,7				259,7				259,7				259,7				259,7		
Próximo vencimiento de Repo (16 de agosto del 2010)													50,0				50,0		
Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de marzo del 2010													0,0				0,0		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	56,8				323,4				371,6				0,0				14,2		
i. Compras (millones de US\$)	20,0				114,0				131,0				0,0				5,0		
Tipo de cambio promedio	2,8380				2,8370				2,8364								2,8370		
ii. Ventas (millones de US\$)																			
Tipo de cambio promedio																			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)																			
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0		
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público																			
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	865,5				830,0				864,3				726,4				775,5		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)																			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0053%				0,0053%				0,0053%				0,0053%				0,0053%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																			
Tasa de interés	2,05%				2,05%				2,05%				2,05%				2,05%		
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional																			
Tasa de interés	2,05%				2,05%				2,05%				2,05%				2,05%		
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0				0,0				0,0				0,0				7,5		
Tasa de interés	0,45%				0,45%				0,45%				0,45%				0,45%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	865,5				830,0				864,3				726,4				768,0		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 259,7				3 241,6				3 225,9				3 230,9				3 235,4		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6				6,6				6,5				6,5				6,5		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 119,7				1 101,6				1 447,3				1 452,4				1 456,9		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,3				2,2				2,9				2,9				2,9		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	40,0				307,0				402,0				424,0				615,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,20/1,23/1,22				1,23/1,23/1,23				1,20/1,23/1,23				1,20/1,23/1,22				1,10/1,23/1,22		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	172,0				299,0				164,5				105,0				220,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40/0,45/0,44				0,40/0,45/0,43				0,40/0,40/0,40				0,35/0,40/0,40				0,35/0,40/0,40		
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	195,1				557,8				513,7				505,2				350,1		
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)																			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)																			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)																			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	12 marzo				15 marzo				16 marzo				17 marzo				18 marzo		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-118,2				53,4				-63,1				-48,6				41,4		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-159,9				31,5				-129,3				-28,8				69,8		
a. Mercado spot con el público	40,5				92,3				21,3				145,4				101,5		
i. Compras	226,3				226,2				166,2				281,6				250,1		
ii. (-) Ventas	185,9				133,9				144,9				136,2				148,6		
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	49,0				-7,5				52,2				-24,4				-19,0		
i. Pactadas	111,7				137,9				57,8				69,0				81,8		
ii. (-) Vencidas	62,7				145,4				5,6				93,3				100,8		
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-2,6				-29,5				-14,0				-4,6				9,5		
i. Pactadas	108,9				44,1				38,4				88,8				99,5		
ii. (-) Vencidas	111,5				73,6				52,4				93,4				90,0		
d. Operaciones cambiarias interbancarias																			
i. Al contado	286,6				103,0				345,3				415,3				268,0		
ii. A futuro	20,0				50,0				50,0				95,0				30,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-25,0				-112,7				12,2				-45,1				-50,2		
i. Compras	34,3				27,9				16,6				48,4				48,4		
ii. (-) Ventas	59,3				140,6				4,5				90,4				98,6		
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-136,5				-20,0				-116,0				-129,0				7,7		
g. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera																			
Tasa de interés																			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8372				2,8389				2,8370				2,8363				2,8380		
(*) Datos preliminares																			

d. = día(s)
s. = semana(s)
m. = mes(es)
a. = año(s)