

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

	22 Marzo			23 Marzo			24 Marzo		25 Marzo		26 Marzo	
	2 253,7			2 045,6			2 255,8		2 570,7		2 742,3	
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)	999,8	150,0	750,0	1 000,0	150,0	507,1	820,2	154,0	696,1	922,7	799,9	1 400,0
Propuestas recibidas	1 219,9	376,0	804,1	1 214,3	195,5	507,1	905,2	154,0	696,1	922,7	1 259,0	1 754,5
Plazo de vencimiento	1 d.	98 d.	1 d.	1 d.	97 d.	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	3 d.	3 d.
Tasas de inte Mínima	1,20	1,36	1,20	1,20	1,38	1,16	1,20	1,20	1,20	1,20	1,20	1,20
Máxima	1,23	1,38	1,23	1,23	1,40	1,23	1,23	1,23	1,23	1,23	1,24	1,24
Promedio	1,23	1,37	1,23	1,23	1,40	1,19	1,23	1,23	1,23	1,23	1,23	1,21
Saldo	21 787,3			21 694,6			21 161,7		21 806,3		22 287,4	
Próximo vencimiento de CD BCRP (26 de marzo del 2010)									1 718,8		2 299,9	
Vencimientos de CD BCRP del 26 de marzo del 2010									1 718,8		2 299,9	
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 Reajustable 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 26 de marzo del 2010									0,0		0,0	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0			286,4			178,7		0,0		0,0	
i. Compras (millones de US\$)				101,0			63,0					
Tipo de cambio promedio				2,8360			2,8360					
ii. Ventas (millones de US\$)				0,0			0,0					
Tipo de cambio promedio				0,0			0,0					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)				0,0			0,0				0,0	
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				0,0			0,0				0,0	
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				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												
ii. Compras de BTP												
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	495,7			783,4			1 591,6		1 089,3		698,9	
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 regulación 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		1,5		84,0	
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	495,7			783,4			1 587,4		1 087,8		614,9	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 106,7			3 525,7			3 528,5		3 531,0		3 533,4	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3			7,1			7,1		7,1		7,1	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 328,1			1 470,9			1 473,7		1 476,3		1 478,7	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,7			3,0			3,0		3,0		3,0	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP												
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	688,0			770,4			824,0		883,0		451,8	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,20/1,28/1,24			1,20/1,28/1,24			1,20/1,28/1,25		1,20/1,25/1,25		1,00/1,28/1,23	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	50,0			111,0			92,9		102,0		201,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,35/0,40/0,39			0,35/0,40/0,39			0,30/0,40/0,33		0,25/0,25/0,25		0,20/0,25/0,24	
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	473,8			542,8			655,0		525,0		298,1	
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\$)	19 marzo			22 marzo			23 marzo		24 marzo		25 marzo	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	85,3			43,3			-118,3		-20,2		-1,9	
a. Operaciones spot con el público	124,7			104,5			72,1		88,0		52,7	
i. Compras	314,2			298,4			210,5		251,5		202,6	
ii. (-) Ventas	189,4			193,9			138,5		163,4		149,9	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	16,9			31,2			1,6		19,9		-25,0	
i. Pactadas	77,5			81,8			17,7		35,9		63,9	
ii. (-) Vencidas	60,6			50,6			16,1		15,9		88,9	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-74,2			-46,8			65,1		-17,8		7,1	
i. Pactadas	89,3			105,9			99,1		83,5		84,5	
ii. (-) Vencidas	163,5			59,2			37,0		101,2		77,4	
d. Operaciones cambiarias interbancarias												
i. Al contado	246,0			72,3			196,6		140,4		272,8	
ii. A futuro	0,0			58,0			0,0		20,0		0,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-18,3			-34,1			-6,7		11,0		-33,2	
i. Compras	37,0			5,4			5,5		22,7		38,6	
ii. (-) Ventas	55,3			39,5			12,2		11,8		71,7	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-9,3			-3,0			-102,2		-71,6		-0,8	
d. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera												
Tasa de interés												
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8376			2,8378			2,8360		2,8361		2,8375	
(*) Datos preliminares												

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