

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

	14 Febrero	15 Febrero	16 Febrero	17 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	16 167,3	15 050,4	15 453,1	13 974,5
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		50,0		30,0
Plazo de vencimiento		235,5		134,7
Tasas de interés: Mínima		177 d.		357 d.
Máxima		3,8		4,3
Promedio		3,9		4,4
Saldo	330,0	380,0	380,0	410,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011)			90,0	
Vencimientos de CD BCRP del 21 al 25 de febrero del 2011			0,0	
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)	300,0	110,0	300,0	
Propuestas recibidas	633,5	310,0	685,0	
Plazo de vencimiento	269 d.	269 d.	271 d.	
Tasas de interés: Mínima	0,08	0,09	0,08	
Máxima	0,08	0,10	0,08	
Promedio	0,08	0,10	0,08	
Saldo	7 845,7	7 955,7	8 255,7	8 255,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP (16 de mayo de 2011)			3,0	
Vencimientos de CDV BCRP del 21 al 25 de febrero del 2011			0,0	
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	991,0	991,0	991,0	991,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (21 de marzo de 2011)			100,0	
Vencimientos de CDLD BCRP del 21 al 25 de febrero del 2011			0,0	
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	699,9	11 688,8	243,0	11 372,6
Propuestas recibidas	1 515,5	11 688,8	778,0	11 372,6
Plazo de vencimiento	29 d.	1 d.	30 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	3,54	3,44	3,55	3,46
Máxima	3,55	3,50	3,55	3,50
Promedio	3,55	3,49	3,55	3,49
Saldo	18 298,3	18 225,1	17 778,4	18 143,5
Próximo vencimiento de Depósitos (21 febrero del 2011)			10 825,9	
Vencimientos de Depósitos del 21 al 25 de febrero del 2011			10 825,9	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP				
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	3 478,6	3 274,8	3 327,2	2 753,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0127%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	4,30%	4,30%	4,30%	4,30%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	2,70%	2,70%	2,70%	2,70%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 478,6	3 274,8	3 327,2	2 753,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 922,0	2 922,0	2 922,0	2 922,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,8	4,8	4,8	4,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	0,0	0,0	0,0	0,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	613,5	781,5	438,0	291,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,45/3,50/3,50	3,45/3,50/3,50	3,45/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	74,0	196,3	165,0	194,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,00/2,00/2,00	1,70/2,00/1,99	1,75/2,05/1,96	1,75/2,05/1,93
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	4,5	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		1,00/1,77		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Febrero	14 Febrero	15 Febrero	16 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-38,4	21,0	-41,9	-8,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-36,5	45,6	-43,0	-214,8
a. Mercado spot con el público	167,4	202,1	-58,7	-94,8
i. Compras	335,9	415,5	313,8	292,6
ii. (-) Ventas	168,5	213,5	372,4	387,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	119,4	-73,2	-57,8	120,7
i. Pactadas	171,0	63,6	69,8	206,9
ii. (-) Vencidas	51,7	136,8	127,6	86,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	121,3	-48,5	-58,9	-85,4
i. Pactadas	200,4	119,2	70,7	76,2
ii. (-) Vencidas	79,1	167,7	129,6	161,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	371,8	166,5	680,5	407,6
ii. A futuro	60,0	55,0	10,0	108,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-44,4	-124,3	21,7	31,6
i. Compras	0,6	10,3	63,2	115,3
ii. (-) Ventas	45,0	134,6	41,5	83,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-132,1	-1,2	-3,9	-76,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7652	2,7665	2,7695	2,7688
(*) Datos preliminares				

d. = día(s)

s. = semana(s)

m. = mes(es)

a. = año(s)

18 Febrero
12 721,0
410,0
90,0
0,0
<u>300,0</u>
690,0
270 d.
0,08
0,08
0,08
8 555,7
3,0
0,0
991,0
100,0
0,0
1 000,1 8 999,9
1 832,0 9 490,2
14 d. 3 d.
3,50 3,41
3,50 3,50
3,50 3,49
<u>17 952,5</u>
8 999,9
10 349,9
<u>0,0</u>
2 421,0
0,0115%
4,30%
4,30%
<u>0,0</u>
2,70%
2 421,0
2 922,0
4,8
0,0
0,0
<u>464,0</u>
3,45/3,50/3,50
125,0
2,00/2,65/2,44
<u>0,0</u>
17 Febrero
-19,3
-16,9
19,6
311,6
292,0
-107,3
59,3
166,6
-104,8
103,1
207,9
317,2
45,0
5,2
169,0
163,8
-0,3
2,7668