

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

	28 Febrero	1 Marzo	2 Marzo	3 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 275,2	8 940,1	9 977,6	10 979,1
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		93,5		120,7
Tasas de interés: Mínima		196 d.		378 d.
Máxima		3,9		4,3
Promedio		4,0		4,3
Saldo	490,0	540,0	540,0	570,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011)			90,0	
Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de marzo del 2011			0,0	
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	10 055,7	10 055,7	10 055,7	10 055,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP (16 de mayo de 2011)			3,0	
Vencimientos de CDV BCRP del 7 al 11 de marzo 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 7 al 11 de marzo del 2011			0,0	
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas	6 339,9		579,1	623,0
Plazo de vencimiento	6 339,9		579,1	623,0
Tasas de interés: Mínima	1 d.		1 d.	1 d.
Máxima	3,35		3,45	3,48
Promedio	3,50		3,50	3,50
Saldo	3,49		3,49	3,50
Próximo vencimiento de Depósitos (7 de marzo del 2011)	15 452,5	9 112,6	8 691,7	7 735,6
Vencimientos de Depósitos del 7 al 11 de marzo del 2011			1 579,1	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			2 579,2	
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\$)				
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	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				
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	2 935,3	8 890,1	9 398,5	10 326,1
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				
Tasa de interés	267,5	382,0	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	2 667,8	8 508,1	9 398,5	10 326,1
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	4,5	4,6	4,7
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	320,0	378,0	519,2	415,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,50/3,50/3,50	3,50/3,50/3,50	3,45/3,50/3,49	3,45/3,50/3,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	66,5	54,0	79,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		3,00/3,00/3,00	3,00/3,60/3,35	3,75/3,75/3,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	0,0	0,0	0,0
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\$)	25 Febrero	28 Febrero	1 Marzo	2 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	18,7	24,8	1,6	-5,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	26,6	1,2	109,6	33,7
a. Mercado spot con el público	95,7	42,4	182,0	106,6
i. Compras	282,7	350,0	361,4	286,1
ii. (-) Ventas	186,9	307,6	179,4	179,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	66,3	59,8	-100,8	-40,0
i. Pactadas	148,4	232,2	132,0	94,7
ii. (-) Vencidas	82,1	172,4	232,8	134,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	74,1	36,2	7,2	-0,5
i. Pactadas	196,3	190,2	158,0	124,1
ii. (-) Vencidas	122,2	154,0	150,8	124,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	506,1	600,1	666,3	893,5
ii. A futuro	0,0	235,0	40,0	150,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-28,9	-52,4	-149,7	-87,5
i. Compras	47,2	116,2	82,3	45,5
ii. (-) Ventas	76,1	168,7	232,0	133,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,2	-7,1	-4,7	4,4
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7756	2,7742	2,7769	2,7745
(*) Datos preliminares				

d. = día(s)

s. = semana(s)

m. = mes(es)

a. = año(s)

4 Marzo
11 971,1
570,0
90,0
0,0
<u>200,0</u>
549,0
276 d.
0,03
0,07
0,07
10 255,7
3,0
0,0
991,0
100,0
0,0
1 150,8
1 150,8
3 d.
3,48
3,50
3,49
<u>7 263,3</u>
1 825,8
3 685,3
<u>0,0</u>
10 620,3
0,0115%
4,30%
4,30%
<u>0,0</u>
2,70%
10 620,3
2 922,0
4,7
0,0
0,0
433,0
3,45/3,50/3,50
194,7
3,75/4,55/4,37
<u>7,0</u>
3 Marzo
-30,1
-15,0
34,5
797,7
763,2
-18,4
117,7
136,1
-3,3
132,0
135,3
520,5
55,0
-50,1
67,0
117,1
-0,1
2,7701