

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

	14 Marzo			15 Marzo			16 Marzo			17 Marzo		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	13 418,8			12 173,8			10 051,2			8 548,1		
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				176,7						113,8		
Tasas de interés: Mínima				182,0						364,0		
Máxima				4,00						4,35		
Promedio				4,15						4,50		
Saldo	650,0			700,0			700,0			730,0		
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011)										90,0		
Vencimientos de CD BCRP del 18 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	10 855,7			10 855,7			10 855,7			10 855,7		
Próximo vencimiento de CDV BCRP (16 de mayo de 2011)										3,0		
Vencimientos de CDV BCRP del 18 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 18 de marzo del 2011										0,0		
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 000,0	1 000,0	7 499,9	1 000,1	1 000,0	7 200,2	500,0	1 000,1	5 999,7	500,0	1 000,1	4 500,3
Propuestas recibidas	1 513,0	1 522,0	8 683,4	1 240,0	2 015,0	8 029,2	1 030,0	1 830,0	6 756,6	1 048,0	1 230,0	5 143,1
Plazo de vencimiento	31 d.	14 d.	1 d.	31 d.	14 d.	1 d.	30 d.	14 d.	1 d.	32 d.	14 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	3,77	3,75	3,71	3,77	3,75	3,71	3,77	3,75	3,72	3,79	3,76	3,71
Máxima	3,77	3,77	3,75	3,77	3,76	3,75	3,78	3,76	3,75	3,80	3,76	3,75
Promedio	3,77	3,77	3,75	3,77	3,76	3,74	3,78	3,76	3,74	3,79	3,76	3,74
Saldo	13 339,5						14 639,6			13 962,3		
Próximo vencimiento de Depósitos (18 de marzo del 2011)										4 500,3		
Vencimientos de Depósitos del 18 de marzo del 2011										4 500,3		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR												
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	3 918,9			2 923,5			2 551,4			2 517,7		
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	4,55%			4,55%			4,55%			4,55%		
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional												
Tasa de interés	4,55%			4,55%			4,55%			4,55%		
d. Depósitos Overnight en moneda nacional												
Tasa de interés	0,0			0,0			8,0			0,0		
	2,95%			2,95%			2,95%			2,95%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 918,9			2 923,5			2 543,4			2 517,7		
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) (*)	4,7			4,7			4,7			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												
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,70/3,75/3,74			3,70/3,75/3,74			3,70/3,75/3,74			3,70/3,75/3,74		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)												
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	46,0			94,5			175,5			266,0		
	1,00/1,20/1,11			0,40/0,75/0,60			0,20/0,40/0,29			0,25/0,25/0,25		
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV												
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,0			10,0			0,0			5,1		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				10,0/4,10						5,1/4,46		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)												
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Marzo			14 Marzo			15 Marzo			16 Marzo		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-37,7			8,4			82,0			-66,2		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-123,5			-39,0			-11,1			-73,5		
a. Mercado spot con el público												
i. Compras	89,6			81,0			61,7			80,3		
ii. (-) Ventas	343,8			359,3			353,1			240,0		
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	254,2			278,3			288,5			320,3		
i. Pactadas	-64,1			-47,0			53,0			-33,7		
ii. (-) Vencidas	18,9			159,7			68,1			152,7		
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	82,9			206,7			15,1			186,3		
i. Pactadas	-149,8			-94,5			-40,1			-41,0		
ii. (-) Vencidas	113,2			106,1			98,7			11,5		
d. Operaciones cambiarias interbancarias	263,1			200,5			138,8			52,5		
i. Al contado	379,6			388,6			796,1			1235,9		
ii. A futuro	55,0			188,0			128,0			111,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-32,6			-128,2			59,7			-126,8		
i. Compras	45,8			56,6			66,4			52,3		
ii. (-) Ventas	78,4			184,7			6,7			179,1		
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,3			2,0			-8,9			-0,2		
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera												
Tasa de interés												
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7685			2,7688			2,7702			2,7697		
(*) Datos preliminares												

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