

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	6 Febrero	7 Febrero	8 Febrero	9 Febrero	10 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 676,3	10 088,1	10 210,0	11 954,0	12 309,9
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 (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	300,0	100,0	200,0	200,0	200,0
Plazo de vencimiento	1 051,0	457,0	510,0	878,0	300,0
Tasas de interés Mínima	94 d	184 d.	184 d.	93 d.	363 d
Máxima	4,10	4,13	4,14	4,13	4,09
Promedio	4,16	4,15	4,16	4,13	4,12
Saldo	4,14	4,15	4,15	4,10	4,10
Próximo vencimiento de CD BCRP (15 de febrero de 2012)	16 490,1	16 790,1	17 090,1	16 370,0	16 970,0
Vencimientos de CD BCRP del 13 al 17 de febrero de 2012		1 220,1		300,0	300,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 500,0	2 300,0	3 500,0	5 000,0	5 599,9
Plazo de vencimiento	3 908,7	4 714,1	5 289,0	6 729,8	8 348,6
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,10	4,10	4,10	4,09	4,07
Promedio	4,19	4,18	4,17	4,23	4,20
Saldo	4,15	4,14	4,13	4,15	4,13
Próximo vencimiento de Depósitos (13 de febrero de 2012)	1 500,0	2 300,0	3 500,0	5 000,0	6 599,9
Vencimientos de Depósitos del 13 al 17 de febrero de 2012					300,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	196,2	634,4	370,9	80,6	1 313,0
Tipo de cambio promedio	73,0	236,0	138,0	30,0	489,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,6880	2,6880	2,6880	2,6850	2,6851
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	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	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	8 072,6	7 922,5	6 781,0	6 454,0	6 423,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0131%	0,0131%	0,0131%	0,0131%	0,0143%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	8 072,6	7 922,5	6 781,0	6 454,0	6 423,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 389,1	12 198,5	11 952,1	11 216,5	11 743,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,9	17,6	17,3	16,2	16,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 943,0	8 752,4	8 741,7	8 506,0	8 297,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,0	12,7	12,3	11,2	11,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	706,0	629,0	463,6	743,0	753,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,22	4,10/4,25/4,22	4,15/4,25/4,21	4,10/4,25/4,22	4,15/4,25/4,19
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	54,5	247,4	203,3	68,0	81,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,50/2,25	2,20/2,60/2,52	2,50/2,60/2,52	1,85/2,50/2,33	1,25/1,50/1,47
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	201,0	30,0	258,7	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\$)	3 Febrero	6 Febrero	7 Febrero	8 Febrero	9 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	48,2	-89,4	-11,5	115,4	148,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	45,2	-108,7	-93,5	21,5	125,4
a. Mercado spot con el público	49,8	-64,6	157,6	167,6	202,5
i. Compras	241,2	197,6	354,2	304,9	374,3
ii. (-) Ventas	191,3	262,3	196,6	137,4	171,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	32,6	-82,1	47,3	96,4	67,3
i. Pactadas	75,6	42,3	60,4	156,3	128,6
ii. (-) Vencidas	43,0	124,5	13,1	59,9	61,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	29,6	-101,4	-34,7	2,5	44,6
i. Pactadas	45,9	27,6	49,8	141,7	194,3
ii. (-) Vencidas	16,4	129,0	84,5	139,3	149,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	287,0	188,5	452,2	249,3	322,5
ii. A futuro	40,0	40,0	0,0	135,0	47,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-31,3	28,9	56,5	71,2	27,4
i. Compras	0,2	124,5	66,7	129,0	83,4
ii. (-) Ventas	31,5	95,6	10,2	57,7	56,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-68,4	-236,2	-138,0	-16,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6890	2,6890	2,6890	2,6878	2,6869
(*) Datos preliminares					