

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	20 Febrero	21 Febrero	22 Febrero	23 Febrero	24 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	12 334,9	12 247,7	12 249,9	12 164,3	12 479,8
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	200,0	100,0	200,0	100,0	200,0
Plazo de vencimiento	540,5	488,2	662,5	396,0	507,0
Tasas de interés Mínima	353 d	170 d	352 d	350 d	350 d
Máxima	4,06	4,03	4,03	3,98	3,97
Promedio	4,06	4,07	4,06	4,02	4,02
Saldo	4,05	4,05	4,06	4,02	4,02
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de marzo de 2012)	17 370,0	17 670,0	17 970,0	18 270,0	18 470,0
Vencimientos de CD BCRP del 27 febrero al 2 de marzo de 2012	1 150,0	1 150,0	1 150,0	1 150,0	1 150,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	5 212,5	5 800,0	5 865,6	6 099,8	6 632,1
Plazo de vencimiento	5 212,5	6 001,3	5 865,6	6 670,2	6 632,1
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4,16	4,05	4,17	4,20	4,15
Promedio	4,25	4,25	4,25	4,25	4,25
Saldo	4,23	4,23	4,23	4,24	4,23
Próximo vencimiento de Depósitos (27 de febrero de 2012)	5 212,5	5 800,0	5 865,6	6 099,8	6 632,1
Vencimientos de Depósitos del 27 febrero al 2 de marzo de 2012	5 800,0	5 800,0	5 800,0	5 800,0	6 632,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	50,9	664,6	356,4	318,8	112,5
Tipo de cambio promedio	19,0	248,0	133,0	119,0	42,0
ii. Ventas (millones de US\$)	2,6800	2,6799	2,6800	2,6790	2,6790
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					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	6 973,3	6 812,3	6 440,7	6 083,2	5 760,3
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%	0,0131%
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					
Tasa de interés	5,2	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	6 968,1	6 812,3	6 440,7	6 083,2	5 760,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 649,2	10 258,4	10 483,1	10 531,2	10 489,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,1	13,9	14,9	15,0	14,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 722,2	7 065,4	7 130,6	7 099,3	7 043,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,2	9,2	10,0	10,1	10,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25/1,40/1,27	1,00/1,10/1,02	1,00/1,10/1,01	1,00/1,30/1,08	1,00/1,40/1,32
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	40,0	4,0	50,0	0,0	62,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					10/4,00
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 Febrero	20 Febrero	21 Febrero	22 Febrero	23 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-23,4	91,0	-68,3	-120,8	13,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-8,7	90,8	-138,7	-21,8	-66,6
a. Operaciones spot con el público	139,3	129,9	163,5	115,3	17,5
i. Compras	410,2	355,6	393,1	356,0	206,9
ii. (-) Ventas	270,9	225,8	229,6	240,7	189,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-30,8	-22,0	123,4	-85,5	-19,4
i. Pactadas	32,0	26,3	248,9	136,2	108,0
ii. (-) Vencidas	62,8	48,3	125,5	221,7	127,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-16,1	-22,2	53,1	13,5	-99,4
i. Pactadas	51,3	8,2	254,2	116,2	113,1
ii. (-) Vencidas	67,4	30,4	201,1	102,8	212,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	298,3	381,7	452,5	725,5	392,3
ii. A futuro	35,0	35,0	206,0	139,0	86,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-29,2	-43,1	18,4	-122,1	82,2
i. Compras	30,3	0,3	140,8	97,4	206,3
ii. (-) Ventas	59,5	43,3	122,5	219,5	124,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-114,3	-13,9	-245,0	-134,0	-81,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6810	2,6807	2,6796	2,6800	2,6790
(*) Datos preliminares					