

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	2 Abril	3 Abril	4 Abril
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	12 507,0	12 180,1	11 608,6
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		100,0	
Plazo de vencimiento		368,7	
Tasas de interés Mínima		189,0	
Máxima		4,21	
Promedio		4,23	
Saldo	21 091,5	21 191,5	21 191,5
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de abril de 2012)	1 400,0	1 400,0	1 400,0
Vencimientos de CD BCRP del 9 al 13 de abril de 2012	0,0	1 400,0	1 400,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de Depósitos			
Vencimientos de Depósitos del 9 al 13 de abril de 2012			
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	200,1	173,4	149,3
i. Compras (millones de US\$)	75,0	65,0	56,0
Tipo de cambio promedio	2,6678	2,6670	2,6668
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	12 707,0	12 253,4	11 757,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0132%	0,0132%	0,0139%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	97,3	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	12 707,0	12 156,1	11 757,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 682,9	12 682,9	12 348,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	27,3	27,3	18,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 950,9	7 950,9	8 902,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19,9	19,9	13,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	513,0	983,8	1 191,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,15/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	88,6	51,0	20,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,00/3,00/1,45	1,00/2,00/1,02	2,60/3,00/2,95
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	850,0	528,0	636,0
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\$)	30 Marzo	2 Abril	3 Abril
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-57,8	-66,1	149,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	17,6	-100,0	258,2
a. Mercado spot con el público	196,3	-7,1	326,1
i. Compras	434,3	245,5	580,5
ii. (-) Ventas	238,1	252,5	254,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	22,9	96,4	-121,1
i. Pactadas	84,2	123,1	147,3
ii. (-) Vencidas	61,3	26,8	268,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	98,3	62,4	-12,7
i. Pactadas	282,5	103,3	207,6
ii. (-) Vencidas	184,2	40,8	220,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	513,1	419,6	731,4
ii. A futuro	63,0	166,0	98,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	77,6	-9,8	-50,3
i. Compras	103,7	15,3	196,7
ii. (-) Ventas	26,1	25,1	247,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-133,4	-69,1	-65,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6675	2,6671	2,6673
(*) Datos preliminares			