

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

| | 2 enero | 3 enero | 4 enero |
|--|---------------------|-----------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 19 490,8 | 20 268,2 | 20 358,7 |
| 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 | | 50,0 | |
| Plazo de vencimiento | | 238,9 | |
| Tasas de interés Mínima | | 371 d | |
| Máxima | | 3,90 | |
| Promedio | | 3,92 | |
| Saldo | | 3,91 | |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (8 de Enero de 2013) | 20 804,7 | 20 854,7 | 20 854,7 |
| Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de Enero de 2013 | | | 300,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | 900,0 |
| Propuestas recibidas | | 2 000,0 | 1 500,1 |
| Plazo de vencimiento | | 6 797,9 | 6 792,0 |
| Tasas de interés Mínima | | 1 d | 3 d |
| Máxima | | 3,80 | 3,85 |
| Promedio | | 4,15 | 4,05 |
| Saldo | | 4,06 | 3,96 |
| Próximo vencimiento de Depósitos 7 de Enero 2013 | | 2 000,0 | 1 500,1 |
| Vencimientos de Depósitos del 7 al 11 de Enero de 2013 | | | 1 500,1 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 102,1 | 102,0 | 254,6 |
| i. Compras (millones de US\$) | 40,0 | 40,0 | 100,0 |
| Tipo de cambio promedio | 2,5516 | 2,5491 | 2,5455 |
| 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 | 19 592,8 | 18 320,2 | 19 113,1 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0138% | 0,0138% | 0,0138% |
| 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 | 411,0 | 0,0 | 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 | 19 181,8 | 18 320,2 | 19 113,1 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 16 099,7 | 17 853,1 | 19 769,1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 19,2 | 22,5 | 23,4 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 12 057,2 | 14 728,1 | 15 824,4 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 14,7 | 17,8 | 18,8 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 405,0 | 185,0 | 281,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,15/4,25/4,24 | 4,10/4,25/4,15 | 4,10/4,20/4,20 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 61,5 | 34,0 | 10,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,75/2,00/1,98 | 1,75/2,25/2,07 | 2,30/2,30/2,30 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 3,0 | 40,0 | 0,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | 20,0 / 3,90 | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 31 Diciembre | 02 Enero | 03 Enero |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 86,0 | -11,2 | 7,5 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 91,4 | -57,7 | 83,6 |
| a. Mercado spot con el público | 88,1 | -16,9 | 122,0 |
| i. Compras | 143,2 | 224,4 | 442,7 |
| ii. (-) Ventas | 55,1 | 241,3 | 320,7 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -8,1 | 98,8 | -184,0 |
| i. Pactadas | 3,6 | 290,8 | 222,1 |
| ii. (-) Vencidas | 11,6 | 192,0 | 406,1 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -2,6 | 52,2 | -107,9 |
| i. Pactadas | 3,0 | 305,4 | 174,5 |
| ii. (-) Vencidas | 5,6 | 253,2 | 282,4 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | |
| i. Al contado | 0,0 | 971,0 | 1361,2 |
| ii. A futuro | 0,0 | 92,0 | 381,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -2,7 | 53,0 | -118,0 |
| i. Compras | 0,0 | 236,8 | 271,7 |
| ii. (-) Ventas | 2,7 | 183,8 | 389,7 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 0,0 | -32,7 | -44,1 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | |
| Tasa de interés | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,5505 | 2,5483 | 2,5503 |
| (*) Datos preliminares | | | |