

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	14 enero	15 enero	16 enero	17 enero	18 enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	21 974,6	23 465,3	23 832,9	24 355,0	24 590,0
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		50,0 100,0	100,0	50,0 100,0	100,0
Plazo de vencimiento		444,7 510,0	210,3	381,5 373,3	242,5
Tasas de interés		175 d 175 d	358 d	357 d 357 d	356 d
Mínima		3,75	3,78	3,80	3,80
Máxima		3,81	3,83	3,85	3,85
Promedio		3,77	3,80	3,85	3,81
Saldo	20 454,7	20 604,7	20 704,7	20 854,7	20 954,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Febrero de 2013)					2 000,0
Vencimientos de CD BCRP del 21 al 25 de Enero de 2013					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	7 800,0	3 999,9 5 500,0	4 000,0 5 800,1	4 000,0 6 500,0	4 000,1 8 299,9
Propuestas recibidas	15 190,4	12 045,5 12 629,4	9 803,0 13 363,3	14 208,3 13 892,7	13 139,3 12 841,6
Plazo de vencimiento	1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	3 d 3 d
Tasas de interés	4,00	4,00 3,95	3,95 3,90	3,87 3,83	3,70 3,58
Mínima	4,05	4,03 4,00	4,00 3,95	3,91 3,86	3,80 3,73
Máxima	4,03	4,02 3,99	3,99 3,93	3,89 3,84	3,78 3,64
Promedio	4,03	4,02	3,99	3,89	3,78
Saldo	7 800,0	9 499,9	9 800,1	10 500,0	12 300,0
Próximo vencimiento de Depósitos 21 de Enero 2013					12 300,0
Vencimientos de Depósitos del 21 al 25 de Enero de 2013					12 300,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	888,3	762,4	381,9	382,2	51,1
i. Compras (millones de US\$)	350,0	300,0	150,0	150,0	20,0
Tipo de cambio promedio	2,5379	2,5412	2,5458	2,5481	2,5528
ii. Ventas (millones de US\$)					
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	15 062,9	14 577,8	14 314,7	14 087,2	12 241,0
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%	0,0138%	0,0138%
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	2 470,0
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	15 062,9	14 577,8	14 314,7	13 597,2	9 771,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	20 519,8	20 594,0	20 265,8	20 117,8	19 791,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	24,0	24,1	23,7	23,5	23,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	16 797,3	16 454,8	16 334,1	16 203,8	15 846,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19,4	19,5	19,1	18,9	18,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	97,0	134,0	88,0	212,0	240,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,05/4,15/4,12	3,95/4,20/4,10	4,00/4,20/4,13	3,95/4,25/4,16	3,70/4,25/4,09
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	87,6	76,6	119,5	120,5	147,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,80/5,00/4,88	5,00/5,00/5,00	5,00/5,15/5,02	5,00/5,50/5,17	5,30/5,50/5,36
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	101,0	37,0	38,0	85,8	6,0
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)			33,0 / 3,80	3,0 / 3,76	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				21,3 / 3,81	6,0 / 3,80
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Enero	14 Enero	15 Enero	16 Enero	17 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	19,2	-189,6	105,1	17,2	17,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	194,4	-199,0	-134,0	-83,1	151,0
a. Mercado spot con el público	258,3	145,3	187,9	92,4	294,9
i. Compras	589,4	417,8	497,0	311,6	554,1
(-) Ventas	331,1	272,5	309,0	219,2	259,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	41,3	22,8	136,6	186,7	-127,9
i. Pactadas	187,6	164,8	343,9	281,6	168,4
ii. (-) Vencidas	146,3	142,0	207,3	95,0	296,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	216,5	13,4	-102,5	86,3	6,0
i. Pactadas	222,1	31,1	204,6	180,9	209,0
ii. (-) Vencidas	5,6	17,7	307,1	94,6	203,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1056,9	1 021,5	1 072,0	991,9	1 421,4
ii. A futuro	68,0	128,0	305,0	95,0	108,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-137,0	-117,9	77,0	-25,5	-92,9
i. Compras	3,2	15,6	265,0	62,5	197,1
ii. (-) Ventas	140,2	133,5	188,0	88,0	290,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-67,6	-350,6	-299,2	-150,5	-144,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5482	2,5384	2,5414	2,5449	2,5480
(*) Datos preliminares					