

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	18 febrero	19 febrero	20 febrero	21 febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	28 521,3	27 773,2	27 355,6	27 278,3
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 50,0	50,0 100,0 100,0	200,0 20,0	50,0 100,0 100,0
Plazo de vencimiento	750,2 208,0	230,8 381,8 120,0	560,2 120,0	270,5 207,8 305,0
Tasas de interés	176 d 3,60 3,88	175 d 3,88 3,68 3,75	174 d 3,67 3,75	350 d 3,88 3,67 3,68
Mínima	3,70 3,70	3,69 3,69 3,75	3,68 3,75	3,70 3,75 3,77
Máxima	3,69 3,69	3,69 3,68 3,75	3,68 3,75	3,69 3,71 3,72
Promedio				
Saldo	22 554,7	22 804,7	23 024,7	23 274,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de Marzo de 2013)				2 300,1
Vencimientos de CD BCRP el 22 de Febrero de 2013				0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 999,9 13 300,0	5 000,0 12 400,0	10 000,1 6 999,9	10 000,2 6 999,9
Propuestas recibidas	13 101,0 13 800,4	13 832,1 12 566,4	13 576,0 7 028,4	14 812,0 7 505,7
Plazo de vencimiento	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d	1 d 1 d
Tasas de interés	4,05 4,04	4,04 4,01	4,05 4,05	4,15 4,00
Mínima	4,07 4,14	4,07 4,17	4,24 4,25	4,23 4,25
Máxima	4,06 4,09	4,06 4,11	4,18 4,16	4,21 4,21
Promedio				
Saldo	18 299,9	17 400,0	17 000,0	16 700,1
Próximo vencimiento de Depósitos el 22 de Febrero de 2013				16 700,1
Vencimientos de Depósitos el 22 de Febrero de 2013				16 700,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	51,6	25,8	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	20,0	10,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	2,5783	2,5820		
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	-100,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		100,0		
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	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	10 023,0	10 149,0	10 135,6	10 328,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0136%	0,0136%	0,0136%	0,0136%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	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	10 023,0	10 149,0	10 135,6	10 328,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	19 769,5	20 075,9	19 193,9	18 964,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	22,0	22,3	21,3	21,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	16 082,8	15 138,6	14 876,0	14 659,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17,2	17,5	16,5	16,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	488,3	356,0	331,0	129,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,05/4,20/4,14	4,05/4,20/4,19	4,20/4,20/4,20	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	197,4	42,4	29,4	65,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/3,00/2,39	5,00/6,00/5,71	5,00/7,00/6,83	8,00/9,05/8,88
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	145,0	79,6	62,0	25,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	55,0 / 3,62	79,6 / 3,67	10,0 / 3,68	20,0 / 3,67
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	50,0 / 3,66			5,0 / 3,68
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	15 Febrero	18 Febrero	19 Febrero	20 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.I - c.I + e + f	-15,7	14,5	126,4	-64,5
Flujo de la posición contable = a + b.II - c.II + e + f	-149,4	35,6	108,9	149,9
a. Operaciones spot con el público	81,6	80,3	113,1	138,5
i. Compras	403,2	274,3	329,3	414,2
ii. (-) Ventas	321,6	194,0	216,2	275,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	99,0	-15,6	114,6	-39,6
i. Pactadas	236,4	15,2	282,5	188,7
ii. (-) Vencidas	137,4	30,7	167,9	228,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-34,8	5,6	97,2	174,7
i. Pactadas	30,7	40,0	139,7	257,4
ii. (-) Vencidas	65,5	34,4	42,5	82,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	1 460,2	647,9	1 185,7	1 642,0
ii. A futuro	135,0	70,0	65,0	251,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-92,5	-21,5	-120,0	-142,1
i. Compras	24,0	0,0	30,2	67,5
ii. (-) Ventas	116,5	21,5	150,2	209,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-210,4	-19,6	-9,6	7,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5702	2,5756	2,5831	2,5829
(*) Datos preliminares				