

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS (Millones de Nuevos Soles)

	4 Marzo	5 Marzo	6 Marzo	7 Marzo	8 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	26 042,3	26 447,9	24 748,8	27 249,3	26 809,7
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	100,0 100,0	50,0 90,0	100,0	100,0 50,0	80,0
Plazo de vencimiento	355,3 466,0	282,5 200,0	308,3	443,2 331,5	390,0
Tasas de interés Mínima	190 d 374 d	189 d 373 d	188 d	187 d 371 d	370 d
Máxima	3,64 3,75	3,70 3,85	3,75	3,78 3,78	3,90
Promedio	3,83 3,82	3,82 4,00	3,84	3,90 3,80	3,95
Saldo	3,78 3,80	3,75 3,94	3,79	3,84 3,79	3,94
Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de Marzo de 2013)	24 064,7	24 204,7	24 304,7	22 154,6	22 234,6
Vencimientos de CD BCRP del 11 al 15 de Marzo de 2013					200,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	5 500,0	5 900,0	5 600,0	8 900,1	9 899,9
Propuestas recibidas	13 317,8	12 924,5	12 095,5	14 178,5	11 930,5
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,05	4,05	4,05	4,07	4,08
Máxima	4,13	4,13	4,14	4,15	4,13
Promedio	4,11	4,11	4,11	4,13	4,11
Saldo	5 500,0	5 900,0	5 600,0	8 900,1	9 899,9
Próximo vencimiento de Depósitos (11 de Marzo de 2013)		5 900,0			9 899,9
Vencimientos de Depósitos del 11 al 15 de Marzo de 2013		5 900,0			9 899,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	25,9	26,1	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	0,0	10,0	10,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio		2,5920	2,6062		
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	20 342,3	20 433,8	19 074,9	18 199,2	16 829,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0135%	0,0135%
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	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	20 342,3	20 433,8	19 074,9	18 199,2	16 829,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	24 510,2	26 799,4	26 026,8	25 604,0	25 045,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	32,5	29,1	28,2	27,1	27,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	23 445,6	22 669,8	22 222,6	21 698,0	21 089,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	26,8	24,8	23,9	23,5	22,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	270,0	192,0	552,0	300,9	255,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,23	4,20/4,25/4,24	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	50,0	57,0	82,0	22,8	90,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,00/6,50/6,30	5,95/6,50/6,04	5,15/5,50/5,48	4,00/4,25/4,08	3,00/3,00/3,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	15,0	160,9	97,4	183,1	190,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		59,0 / 3,80	1,1 / 3,75	90,0 / 3,79	50,0 / 3,80
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		57,5 / 3,81	15,0 / 3,87		10,0 / 3,80
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	1 Marzo	4 Marzo	5 Marzo	6 Marzo	7 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-102,6	-10,8	-106,5	88,2	124,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-35,2	80,5	92,0	3,4	78,2
a. Mercado spot con el público	-10,8	72,7	101,3	58,8	106,9
i. Compras	384,5	317,7	311,5	397,4	343,6
ii. (-) Ventas	395,3	245,0	210,2	338,6	236,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-76,9	24,9	-41,4	-80,4	19,2
i. Pactadas	95,2	244,2	251,0	117,9	121,4
ii. (-) Vencidas	172,1	219,3	292,3	198,3	102,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-9,5	116,2	157,1	-165,2	-27,4
i. Pactadas	60,0	124,1	192,0	158,8	134,6
ii. (-) Vencidas	69,5	8,0	34,9	324,0	161,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	585,0	419,8	1 127,2	1 973,1	1 434,1
ii. A futuro	24,0	90,0	126,0	146,0	158,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-122,4	-203,5	-255,7	68,9	16,0
i. Compras	43,4	6,6	34,8	265,6	95,6
ii. (-) Ventas	165,8	210,1	290,5	196,7	79,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,5	-0,1	-11,0	1,4	15,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,5954	2,5978	2,5935	2,5973	2,6033
(*) Datos preliminares					