

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	11 Marzo	12 Marzo	13 Marzo	14 Marzo	15 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	26 750,5	26 810,0	27 037,6	25 989,6	26 077,4
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)		50,0 100,0	100,0	50,0 100,0	100,0 100,0
Propuestas recibidas		457,5 339,1	467,0	349,4 436,0	350,0 560,0
Plazo de vencimiento		182 d 366 d	365 d	364 d 180 d	179 d 363 d
Tasas de interés: Mínima		3,73 3,86	3,89	3,79 3,74	3,76 3,82
Máxima		3,79 3,89	3,91	3,84 3,79	3,82 3,90
Promedio		3,75 3,89	3,91	3,82 3,77	3,80 3,87
Saldo	22 234,6	22 184,6	22 284,6	22 434,6	22 634,6
Próximo vencimiento de CD BCRP (4 de Abril de 2013)					559,5
Vencimientos de CD BCRP del 18 al 22 de Marzo de 2013					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	10 200,0	11 200,1	12 100,1	12 000,1	13 400,1
Propuestas recibidas	15 625,2	16 032,2	16 091,5	16 592,2	17 089,8
Plazo de vencimiento		1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	4,08	4,07	4,08	4,08	4,03
Máxima	4,13	4,12	4,12	4,10	4,08
Promedio	4,11	4,11	4,10	4,09	4,05
Saldo	10 200,0	11 200,1	12 100,1	12 000,1	13 400,1
Próximo vencimiento de Depósitos (18 de Marzo de 2013)					13 400,1
Vencimientos de Depósitos del 18 al 22 de Marzo de 2013					13 400,1
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	233,5	181,6	415,0	259,3
i. Compras (millones de US\$)	0,0	90,0	70,0	160,0	100,0
Tipo de cambio promedio		2,5939	2,5943	2,5936	2,5929
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	16 550,5	15 693,4	15 019,1	14 254,5	12 736,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0135%	0,0136%	0,0135%	0,0135%	0,0135%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	186,0
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	16 550,5	15 693,4	15 019,1	14 254,5	12 550,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	23 937,6	24 195,0	23 189,3	18 210,7	22 464,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	25,9	26,2	25,1	23,0	24,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	20 652,1	19 584,2	16 508,6	18 933,8	18 508,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	21,6	21,9	20,8	18,0	20,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	91,4	340,5	85,4	324,2	260,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,24	4,20/4,30/4,24	4,15/4,25/4,23
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	75,3	85,4	247,6	253,9	245,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,00/3,00	2,45/2,50/2,50	2,25/2,50/2,43	2,40/2,50/2,41	2,40/2,45/2,40
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	117,8	49,6	20,0	36,8
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		32,0 / 3,74	20,0 / 3,70		2,0 / 3,77
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				20,0 / 3,84	30,0 / 3,80
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	8 Marzo	11 Marzo	12 Marzo	13 Marzo	14 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-59,9	50,3	-63,5	74,8	2,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-12,2	-2,2	23,7	-53,6	-35,9
a. <u> Mercado spot con el público</u>	31,4	4,8	139,8	58,4	138,5
i. Compras	363,1	258,0	385,5	269,8	379,7
ii. (-) Ventas	331,7	253,2	245,7	211,4	241,2
b. <u> Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-76,3	-58,2	-106,1	128,7	175,8
i. Pactadas	165,7	137,9	109,7	246,8	305,7
ii. (-) Vencidas	242,0	196,1	215,8	118,1	130,0
c. <u> Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-28,6	-110,7	-18,9	0,3	137,0
i. Pactadas	214,4	5,5	58,1	112,6	159,2
ii. (-) Vencidas	243,0	116,2	77,0	112,3	22,2
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	1 060,5	986,5	1 655,5	941,2	716,1
ii. A futuro	269,0	55,0	160,0	23,0	55,0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-39,1	-87,3	-158,2	-39,8	-118,4
i. Compras	179,4	96,0	50,3	69,1	2,9
ii. (-) Ventas	218,4	183,3	208,5	108,8	121,3
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-3,6	0,5	-96,7	-77,9	-163,7
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,6023	2,5977	2,5919	2,5932	2,5927
(*) Datos preliminares					