

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	18 Mayo	19 Mayo	20 Mayo	21 Mayo	22 Mayo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	834,1	654,1	278,3	707,5	401,6
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 (CDBCRP)	--	--	--	--	--
Saldo	2 615,8	2 615,8	2 615,8	2 615,8	2 615,8
Próximo vencimiento de CD BCRP (09 de Julio del 2009)			716,0		716,0
Vencimientos de CD BCRP del 20 al 22 de mayo del 2009			0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)			200,0	200,0	200,0
Propuestas recibidas			340,0	200,0	2 000,0
Plazo de vencimiento			2 s.	1 d.	3 d.
Tasas de interés: Mínima			4,05	4,03	4,00
Máxima			4,10	4,03	4,00
Promedio			4,07	4,03	4,00
Saldo	729,1	729,1	1 129,1	929,1	1 129,1
Próximo vencimiento de Repo (03 de junio del 2009)			200,0		200,0
Vencimientos de Repo del 20 al 22 de mayo del 2009			200,0		200,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 681,0	5 681,0	5 681,0	5 496,0	5 416,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (21 de mayo del 2009)			185,0		142,0
Vencimientos de CDR BCRP del 20 al 22 de mayo del 2009			265,0		174,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	--	--	--	--	--
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)	--	--	--	--	--
Saldo	2 541,6	2 541,6	2 541,6	2 541,6	2 541,6
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (03 de Junio del 2009)			878,2		878,2
Vencimientos de CDBCRP del 20 al 22 de mayo del 2009			0,0		0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
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	834,1	654,1	678,3	707,5	601,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0130%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<u>52,9</u>	<u>44,0</u>	<u>43,4</u>	<u>40,0</u>	<u>50,9</u>
Tasa de interés	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	781,2	610,1	634,9	667,5	550,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 879,3	2 872,4	2 867,5	2 864,6	2 856,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,7	6,7	6,7	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	740,8	733,9	729,0	726,0	718,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,7	1,7	1,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>592,5</u>	<u>735,9</u>	<u>854,2</u>	<u>642,5</u>	<u>739,6</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,90/4,00/4,00	4,00/4,05/4,00	3,95/4,05/4,00	3,95/4,05/4,00	3,95/4,00/4,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>10,0</u>	<u>15,5</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,18/0,20/0,19	0,10/0,18/0,13			
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	<u>200,0</u>	<u>200,0</u>	<u>160,0</u>	<u>0,0</u>	<u>2,5</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	15 Mayo	18 Mayo	19 Mayo	20 Mayo	21 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-24,8	30,6	0,4	41,5	-14,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	189,9	-81,7	56,5	14,2	-10,5
a. Mercado spot con el público	<u>122,1</u>	<u>-100,7</u>	<u>74,6</u>	<u>43,4</u>	<u>57,2</u>
i. Compras	211,3	133,2	187,0	223,4	211,2
ii. (-) Ventas	89,3	233,9	112,3	179,9	154,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	<u>41,1</u>	<u>-5,2</u>	<u>-12,8</u>	<u>30,8</u>	<u>-23,7</u>
i. Pactadas	84,8	148,0	74,1	122,4	110,1
ii. (-) Vencidas	213,0	153,2	86,9	91,7	133,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<u>255,7</u>	<u>-117,6</u>	<u>43,2</u>	<u>3,6</u>	<u>-20,0</u>
i. Pactadas	118,5	37,0	45,4	46,1	81,5
ii. (-) Vencidas	32,0	154,5	2,1	42,5	101,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	776,7	511,0	1064,8	512,7	1345,8
ii. A futuro	31,0	67,0	106,0	91,0	35,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<u>-16,5</u>	<u>17,3</u>	<u>-82,9</u>	<u>-46,3</u>	<u>-24,0</u>
i. Compras	24,8	154,0	0,0	41,9	97,2
ii. (-) Ventas	41,4	136,7	82,9	88,2	121,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>-96,6</u>	<u>3,0</u>	<u>-20,0</u>	<u>-32,0</u>	<u>-75,9</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,0211	3,0121	3,0044	2,9874	3,0012
(*) Datos preliminares					