

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	7 Mayo	8 Mayo	9 Mayo	10 Mayo	11 Mayo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	14 447.7	14 645.4	14 672.9	15 194.2	14 810.2
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	50.0	100.0	50.0	100.0
Plazo de vencimiento	194.0	254.6	391.0	113.0	366.0
Tasas de interés Mínima	183 d	182 d	181 d	364 d	179 d
Máxima	4.21	4.19	4.19	4.17	4.20
Promedio	4.22	4.20	4.20	4.21	4.20
Saldo	4.21	4.20	4.20	4.20	4.20
Próximo vencimiento de CD BCRP (15 de mayo de 2012)	21 440.9	21 490.9	21 590.9	21 070.9	21 170.9
Vencimientos de CD BCRP del 14 al 18 de mayo de 2012	620.0	620.0	620.0	1 600.0	1 600.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	4 300.0	4 600.0	4 800.0	5 600.0	5 200.0
Plazo de vencimiento	5 815.1	7 123.2	6 915.0	7 558.3	6 510.1
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	4.13	4.18	4.18	4.18	4.10
Promedio	4.22	4.22	4.21	4.22	4.21
Saldo	4.20	4.20	4.20	4.20	4.20
Próximo vencimiento de Depósitos (14 de mayo de 2012)	4 300.0	4 600.0	4 800.0	5 600.0	5 200.0
Vencimientos de Depósitos del 14 al 18 de mayo de 2012	4 300.0	4 600.0	4 800.0	5 600.0	5 200.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	179.4	63.4	4 800.0	5 600.0	5 200.0
Tipo de cambio promedio	68.0	24.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$)	2 638.9	2 642.0			
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	10 277.1	10 058.8	9 772.9	9 494.2	9 510.2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0133%	0.0133%	0.0133%	0.0133%	0.0132%
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					
Tasa de interés	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
	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	10 277.1	10 058.8	9 772.9	9 494.2	9 510.2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 682.9	12 682.9	14 537.0	12 682.9	14 272.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	27.3	27.3	19.2	27.3	18.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 178.1	11 255.6	11 090.9	10 957.9	10 826.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	14.7	19.9	14.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	790.6	950.6	684.6	555.0	645.6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	140.7	59.8	91.7	69.7	37.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/5,00/4,97	4,00/5,00/4,67	3,00/4,00/3,89	3,50/5,00/4,06	3,50/5,00/4,74
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	594.0	71.0	320.4	37.0	55.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		6,0/4,21	7,9/4,20		2,0/4,21
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	4 Mayo	7 Mayo	8 Mayo	9 Mayo	10 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	219.7	-110.0	33.9	-135.5	81.5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	236.8	-8.0	147.9	11.6	226.9
a. Mercado spot con el público	263.8	79.0	188.2	32.0	250.6
i. Compras	496.9	299.3	432.1	489.0	480.9
ii. (-) Ventas	233.1	220.3	244.0	457.1	240.2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	71.2	-111.8	-41.7	119.0	18.4
i. Pactadas	204.9	63.1	104.7	188.0	185.5
ii. (-) Vencidas	133.7	174.8	146.4	69.1	167.1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	88.3	-9.7	72.4	286.0	163.8
i. Pactadas	136.4	51.4	298.3	313.9	279.4
ii. (-) Vencidas	48.1	61.1	225.9	47.9	115.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	904.8	586.2	1120.1	902.0	840.1
ii. A futuro	160.0	174.2	128.0	130.0	232.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-106.7	-125.7	72.4	-58.0	-84.3
i. Compras	15.2	45.0	216.2	4.9	77.0
ii. (-) Ventas	121.9	170.7	143.8	62.9	161.3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6.0	-75.0	-33.2	16.4	9.0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.6452	2.6379	2.6425	2.6461	2.6472
(*) Datos preliminares					