

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	18 Junio	19 Junio	20 Junio	21 Junio	22 Junio
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>10 692.1</b>	<b>10 504.6</b>	<b>10 063.4</b>	<b>9 831.4</b>	<b>9 235.0</b>
<b>V</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50.0	50.0	50.0	100.0	100.0
Plazo de vencimiento	149.0	298.5	167.0	411.0	204.8
Tasas de interés	360.0	175.0	359.0	174.0	357.0
Mínima	4.19	4.18	4.19	4.18	4.18
Máxima	4.20	4.19	4.19	4.18	4.19
Promedio	4.20	4.19	4.19	4.18	4.18
Saldo	19 790.9	19 940.9	20 040.9	20 190.9	20 290.9
Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de julio de 2012)	1 490.0	1 490.0	1 490.0	1 490.0	1 490.0
Vencimientos de CD BCRP el 22 de junio de 2012					0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 700.0	1 300.0	1 500.0	1 700.0	1 200.0
Plazo de vencimiento	2 772.9	3 203.7	3 253.4	3 114.8	2 037.9
Tasas de interés	1.0	1.0	1.0	1.0	1.0
Mínima	3.99	3.98	3.94	3.91	3.70
Máxima	4.08	4.05	4.03	3.99	3.94
Promedio	4.05	4.02	4.00	3.98	3.78
Saldo	1 700.0	1 300.0	1 500.0	1 700.0	1 200.0
Próximo vencimiento de Depósitos (22 de junio de 2012)					1 200.0
Vencimientos de Depósitos el 22 de junio de 2012					1 200.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 520.0	1 520.0	1 520.0	1 520.0	1 520.0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (23 de julio de 2012)	780.0	780.0	780.0	780.0	780.0
Vencimientos de CDR BCRP el 22 de junio de 2012	0.0				0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio		0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>8 942.1</b>	<b>9 054.6</b>	<b>8 463.4</b>	<b>7 981.4</b>	<b>7 935.0</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0133%	0.0133%	0.0133%	0.0132%	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	84.0	308.5	472.0	145.5	254.5
Tasa de interés	3.45%	3.45%	3.45%	3.45%	3.45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>8 858.1</b>	<b>8 746.1</b>	<b>7 991.4</b>	<b>7 835.9</b>	<b>7 680.5</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	13 176.3	13 055.9	13 010.4	12 931.7	12 849.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	17.3	17.1	17.1	17.0	16.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 731.2	9 610.7	9 565.2	9 486.5	9 404.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12.8	12.6	12.6	12.5	12.4
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	822.9	1 103.6	1 236.3	1 395.9	1 239.8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,15/4,25/4,24	4,05/4,25/4,24	4,00/4,25/4,21	4,00/4,30/4,20
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25.6	173.5	124.8	81.1	46.1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,05/1,01	1,00/1,05/1,01	1,00/1,00/1,00	1,00/1,00/1,00	0,75/1,00/0,85
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	23.0	31.0	426.9	726.9	1 214.4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		8,0 / 4,18			13,0 / 4,18
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>15 Junio</b>	<b>18 Junio</b>	<b>19 Junio</b>	<b>20 Junio</b>	<b>21 Junio</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	39.0	-43.0	-17.7	-121.7	9.9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	7.5	-66.4	56.2	18.6	5.6
a. Mercado spot con el público	17.3	-41.3	54.3	26.5	-4.3
i. Compras	312.0	264.9	359.0	266.2	409.4
ii. (-) Ventas	294.7	306.1	304.6	239.7	413.7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-39.0	48.2	-91.5	-87.1	-93.6
i. Pactadas	119.8	104.1	15.6	80.2	126.8
ii. (-) Vencidas	158.8	55.8	107.0	167.3	220.4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-70.5	24.9	-17.6	53.3	-97.9
i. Pactadas	84.7	249.2	88.9	273.1	75.0
ii. (-) Vencidas	155.2	224.3	106.5	219.8	172.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	1176.0	635.2	788.5	928.5	806.8
ii. A futuro	137.0	151.0	100.0	114.0	162.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-13.3	143.4	1.4	45.6	-46.6
i. Compras	134.7	198.5	105.7	210.7	167.4
ii. (-) Ventas	148.0	55.1	104.3	165.1	214.0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.1	0.0	0.0	-1.0	9.0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.6630	2.6453	2.6385	2.6410	2.6521
(*) Datos preliminares					