

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	16 Julio	17 Julio	18 Julio	19 Julio	20 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 924.8	9 713.3	9 295.4	10 314.0	10 443.6
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 (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	50.0	50.0	50.0	50.0	100.0
Plazo de vencimiento	216.5	427.9	200.7	314.0	222.0
Tasas de interés	360 d	175 d	359 d	357 d	274 d
Minima	3.99	3.98	3.95	3.95	3.94
Máxima	4.10	4.00	3.99	3.96	3.95
Promedio	4.04	3.99	3.98	3.95	3.95
Saldo	19 450.9	19 550.9	19 600.9	18 251.0	18 451.0
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de agosto de 2012)	1 499.9			1 620.1	1 620.1
Vencimientos de CD BCRP del 23 al 26 de julio de 2012					0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 300.0	1 900.0	1 400.0	2 200.0	2 400.0
Plazo de vencimiento	1 519.3	2 501.2	2 474.6	3 126.0	3 494.5
Tasas de interés	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Minima	3.88	3.92	4.00	4.00	4.05
Máxima	4.10	4.18	4.15	4.15	4.15
Promedio	3.99	4.09	4.10	4.14	4.11
Saldo	1 300.0	1 900.0	1 400.0	2 200.0	2 400.0
Próximo vencimiento de Depósitos (23 de julio de 2012)					2 400.0
Vencimientos de Depósitos del 23 al 26 de julio de 2012					2 400.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Minima					
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)	728.0		780.0	780.0	780.0
Vencimientos de CDR BCRP del 23 al 26 de julio de 2012					1 320.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	81.3	296.1	201.8	429.8	0.0
Compras (millones de US\$)	31.0	113.0	77.0	164.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	2 620.0	2 620.0	2 620.0	2 620.0	0.0
Ventas (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaci	8 656.0	8 009.4	8 047.2	8 393.8	7 843.6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0134%	0.0134%	0.0134%	0.0134%	0.0133%
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	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	8 656.0	8 009.4	8 047.2	8 393.8	7 843.6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15 196.9	15 196.9	15 196.9	15 196.9	13 763.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	19.9	19.9	17.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 177.6	10 781.2	10 618.2	10 475.3	10 343.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15.4	15.4	15.4	15.4	13.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	843.0	1 025.5	956.5	1 335.0	1 312.6
Tasas de interés: Minima / Máxima / Promedio	4,15/4,25/4,21	4,15/4,30/4,23	4,15/4,30/4,24	4,15/4,30/4,25	4,20/4,25/4,24
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	66.7	170.2	238.9	347.5	239.5
Tasas de interés: Minima / Máxima / Promedio	0,75/1,00/0,84	0,60/0,80/0,75	0,60/0,75/0,61	0,55/0,65/0,60	0,60/0,60/0,60
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	33.0	350.0	837.0	615.0	320.6
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	2,0 / 4,00		10,0 / 3,98		36,0 / 3,95
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		20,0 / 4,00			40,0 / 3,95
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 Julio	16 Julio	17 Julio	18 Julio	19 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-2.6	137.2	-29.5	-21.2	-17.9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	114.7	74.0	-25.6	-108.7	-149.2
a. Mercado spot con el público	294.0	130.3	85.4	-32.1	14.1
i. Compras	559.3	311.2	290.5	242.5	270.6
ii. (-) Ventas	265.2	180.9	205.1	274.6	256.5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-24.9	7.4	-93.8	100.2	24.3
i. Pactadas	4.4	156.6	72.6	245.8	141.6
ii. (-) Vencidas	29.3	149.2	166.4	145.5	117.4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	92.4	-55.8	-89.9	12.7	-107.0
i. Pactadas	122.1	121.8	78.7	343.7	29.2
ii. (-) Vencidas	29.8	177.5	168.6	330.9	136.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	385.7	488.4	566.3	656.5	467.1
ii. A futuro	158.0	104.5	165.0	85.0	108.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	6.1	2.9	2.4	186.5	19.5
i. Compras	23.0	144.9	165.9	329.4	132.7
ii. (-) Ventas	16.9	141.9	163.5	143.0	113.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-185.0	-31.0	-111.2	-77.7	-164.0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.6247	2.6228	2.6191	2.6198	2.6203
(*) Datos preliminares					