

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	2 Mayo	3 Mayo	4 Mayo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	13 935.7	14 344.5	14 349.8
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
Plazo de vencimiento		159.0	133.0
Tasas de interés Mínima		371 d	186 d
Máxima		4.20	4.20
Promedio		4.20	4.21
Saldo	21 290.3	21 340.9	21 390.9
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de mayo de 2012)	620.0	620.0	620.0
Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de mayo de 2012			620.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		1 000.0	2 400.0
Propuestas recibidas		4 130.0	6 092.4
Plazo de vencimiento		1 d	3 d
Tasas de interés Mínima		3.91	4.00
Máxima		4.20	4.20
Promedio		4.08	4.15
Saldo		1 000.0	2 400.0
Próximo vencimiento de Depósitos (7 de mayo de 2012)			2 400.0
Vencimientos de Depósitos del 7 al 11 de mayo de 2012			2 400.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	498.3	0.0	0.0
i. Compras (millones de US\$)	189.0		
Tipo de cambio promedio	2.6364		
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	14 434.0	13 294.5	11 899.8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0133%	0.0133%	0.0133%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>			
Tasa de interés	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%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	429.0	0.0	0.0
Tasa de interés	3.45%	3.45%	3.45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	14 005.0	13 294.5	11 899.8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 682.9	12 682.9	13 496.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	27.3	27.3	17.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	8 015.6	9 433.9	10 050.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	13.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	440.8	666.8	656.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,20/4,25/4,23	4,20/4,25/4,23
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	71.5	58.5	31.6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,20/4,00/2,85	4,00/4,50/4,47	4,50/5,00/4,77
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	291.6	575.0	11.6
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\$)	30 Abril	2 Mayo	3 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	107.7	-45.8	162.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	36.6	-134.4	204.0
a. <u>Mercado spot con el público</u>	97.1	103.7	210.2
i. Compras	195.6	410.2	444.4
ii. (-) Ventas	98.5	306.5	234.1
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-2.9	84.0	34.1
i. Pactadas	25.7	198.5	186.0
ii. (-) Vencidas	28.5	114.5	151.9
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-74.0	-4.7	75.6
i. Pactadas	27.9	87.8	127.1
ii. (-) Vencidas	101.8	92.4	51.5
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>			
i. Al contado	0.0	466.5	904.0
ii. A futuro	0.0	92.0	85.0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	12.8	-62.9	-107.8
i. Compras	35.6	42.5	38.0
ii. (-) Ventas	22.8	105.4	145.8
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	0.0	-197.3	1.2
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	--	2.6359	2.6396
(*) Datos preliminares			