

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones S/.)

	11 Junio					12 Junio					13 Junio					14 Junio		15 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2,322.1					1,696.7					1,355.9					848.9		592.4
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)																		
Propuestas recibidas	30.0	100.0	20.0	100.0	1590.0	30.0	100.0	30.0	100.0	870.0	20.0	100.0	50.0	80.0	770.0	20.0	495.0	400.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	71.0	137.0	99.0	100.0	1590.0	71.0	162.0	76.0	100.0	870.0	64.5	145.0	58.0	80.0	800.0	44.0	495.0	480.0
Plazo de vencimiento	2 años	6 meses	3 meses	1 semana	1 día	3 años	6 meses	3 meses	1 semana	1 día	2 años	6 meses	3 meses	1 semana	1 día	3 años	1 día	3 días
Saldo	5,48/5,50/5.49	4,93/5,00/4.99	4,85/4,85/4.85	4,59/4,59/4.59	4,49/4,53/4.51	5,56/5,59/5.58	4,98/5,05/5.03	4,85/4,85/4.85	4,60/4,60/4.60	4,49/4,53/4.53	5,48/5,48/5.48	5,03/5,08/5.07	4,90/4,90/4.90	4,60/4,60/4.60	4,49/4,53/4.52	5,58/5,61/5.59	4,49/4,53/4.53	4,49/4,52/4.52
Próximo vencimiento de CDBCRP (13 de junio del 2007)			16,894.4				16,434.4					16,594.4			16,339.4			
Vencimientos de CDBCRP del 13 al 15 junio del 2007																	500.0	
ii. Subasta de compra temporal de valores																		
Propuestas recibidas																		
Plazo de vencimiento																		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio																		
Saldo																		
Próximo vencimiento de CDRBCRP																		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0					0.0					0.0					0.0		126.7
i. Compras (millones de US\$)																		40.0
Tipo de cambio promedio																		3,1681
ii. Ventas (millones de US\$)																		
Tipo de cambio promedio																		
c. Operaciones con el Tesoro Público																		
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público																		
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público																		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	512.1					566.7					325.9					333.9		299.1
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)																		
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0048%					0,0048%					0,0048%					0,0048%		0,0048%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																		
Tasa de interés	5,25%					5,25%					5,25%					5,25%		5,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																		
Tasa de interés	5,25%					5,25%					5,25%					5,25%		5,25%
d. Depósitos Operativos en moneda nacional																		
Tasa de interés	3,75%					3,75%					3,75%					3,75%		3,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	902.9					563.3					325.9					333.9		299.1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1,926.9					1,921.7					1,898.9					1,880.0		1,861.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.4					7.3					7.3					7.2		7.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	626.5					621.2					598.5					579.6		560.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.4					2.4					2.3					2.2		2.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																		
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	130.1					61.3					133.1					198.8		520.4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/4,50/4,50					4,50/4,50/4,50					4,50/4,55/4,51					4,50/4,50/4,50		4,50/4,60/4,57
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	47.0					72.0					25.0					14.0		9.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,15/6,15/6,15					5,50/6,15/5,84					5,90/5,90/5,90					5,50/5,90/5,64		5,50/5,50/5,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP	0.0					28.0					52.2					12.7		45.4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)																		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)																		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)						4,0/5,46												
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	8 Junio					11 Junio					12 Junio					13 Junio		14 Junio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	54.3					13.8					-45.9					32.7		-61.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	94.9					42.1					50.0					20.8		-0.7
a. Mercado spot con el público	97.1					59.4					73.2					31.6		33.6
i. Compras	168.5					158.0					176.1					127.9		145.5
ii. (-) Ventas	69.4					98.6					102.8					96.3		112.0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	3.9					33.9					-71.7					58.6		-138.8
i. Pactadas	77.9					61.6					90.2					151.4		26.9
ii. (-) Vencidas	74.0					27.7					161.9					92.8		165.6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	44.5					62.2					24.2					46.6		-78.3
i. Pactadas	74.0					108.5					79.9					141.1		38.3
ii. (-) Vencidas	29.5					46.4					55.7					94.4		116.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias																		
i. Al contado	82.3					39.2					125.5					137.0		93.0
ii. A futuro	0.0					0.0					5.0					53.0		0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-38.7					0.4					-138.1					-3.0		-75.2
i. Compras	13.5					10.0					15.9					87.0		79.9
ii. (-) Ventas	52.2					9.6					154.0					90.0		155.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-8.0					1.0					8.7					-6.2		-8.1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																		
Tasa de interés																		
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,175					3,171					3,172					3,172		3,170