

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

	09 Julio	10 Julio	11 Julio	12 Julio	13 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1.651,0	1.667,5	2.218,8	1.983,1	1.840,4
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)	45,0 725,0	1.200,1 150,0	300,0 1.700,0 50,0	300,0 1.549,8	250,0 1.496,2
Propuestas recibidas	349,0 837,0	1.547,0 166,0	341,0 1.843,0 70,0	628,0 1.675,6	336,5 1.496,2
Plazo de vencimiento	1 semana 1 día	1 día 1 día	1 semana 1 día 1 día	1 semana 1 día	1 semana 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,77/4,80/4,78 4,64/4,75/4,74	4,72/4,75/4,75 4,72/4,72/4,72	4,78/4,82/4,82 4,64/4,75/4,73 4,72/4,75/4,74	4,80/4,83/4,82 4,72/4,72/4,72	4,80/4,82/4,82 4,65/4,78/4,71
Saldo	15.605,2	16.230,3	16.430,2	16.530,0	16.726,4
Próximo vencimiento de CDBCRP (11 de julio del 2007)					1.541,2
Vencimientos de CDBCRP del 11 al 13 julio del 2007					2.391,2
ii. Subasta de compra temporal de valores					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDRBCRP					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
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	293,8	480,1	379,0	325,3
i. Compras (millones de US\$)		93,0	152,0	120,0	103,0
Tipo de cambio promedio		3,1593	3,1586	3,1586	3,1584
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público			50,0	50,0	50,0
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	881,0	611,2	648,9	512,3	419,5
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0059%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	25,0	48,4
Tasa de interés	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	881,0	611,2	648,9	487,3	371,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2.160,8	2.141,5	2.131,7	2.110,1	2.082,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,2	8,0	8,0	7,9	7,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	776,1	756,7	746,9	725,3	698,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,8	2,8	2,7	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	220,1	96,3	57,0	61,0	67,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,75/4,80/4,75	4,65/4,75/4,74	4,60/4,75/4,73	4,75/4,75/4,75	4,70/4,75/4,73
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	17,0	50,5	114,0	70,0	39,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,95/6,05/6,02	6,00/6,10/6,04	6,05/6,15/6,10	6,15/6,15/6,15	6,15/6,55/6,53
c. Total mercado secundario de CDBCRP	77,4	49,0	110,1	146,0	85,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	13,0/5,09		3,0/5,11	5,0/5,12	4,0/5,12
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	3,4/5,27				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	06 Julio	09 Julio	10 Julio	11 Julio	12 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	33,7	-10,1	20,5	-50,6	-24,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	22,0	72,1	-43,3	-138,6	-42,9
a. Mercado spot con el público	74,0	70,5	64,0	40,9	97,3
i. Compras	213,6	191,7	139,3	153,3	185,8
ii. (-) Ventas	139,6	121,2	75,3	112,5	88,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	34,4	-83,5	82,8	73,9	-43,0
i. Pactadas	37,8	74,1	101,4	132,5	125,3
ii. (-) Vencidas	3,4	157,6	18,6	58,5	168,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	22,7	-1,2	19,0	-14,0	-61,0
i. Pactadas	55,3	96,9	77,9	66,9	116,9
ii. (-) Vencidas	32,6	98,1	58,9	81,0	177,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	111,0	73,0	114,0	122,0	90,0
ii. A futuro	5,0	45,0	0,0	27,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	18,0	-61,4	40,7	-15,7	-14,3
i. Compras	21,0	95,4	55,7	42,3	141,0
ii. (-) Ventas	3,0	156,8	15,0	58,0	155,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-40,8	3,5	-107,7	-141,3	-116,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,164	3,163	3,160	3,158	3,158