

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	22 Junio	23 Junio	24 Junio	25 Junio	26 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	606,9	369,9	358,5	326,0	327,0
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)	<u>200,0</u>				
Propuestas recibidas	220,0				
Plazo de vencimiento	2 s.				
Tasas de interés: Mínima	3,00				
Máxima	3,00				
Promedio	3,00				
Saldo	4 815,8	4 815,8	4 815,8	4 815,8	4 815,8
Próximo vencimiento de CD BCRP (03 de julio del 2009)					250,0
Vencimientos de CD BCRP del 30 de junio al 03 de julio del 2009					250,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	<u>250,0</u>				
Propuestas recibidas	332,0				
Plazo de vencimiento	1 d.				
Tasas de interés: Mínima	3,26				
Máxima	3,26				
Promedio	3,26				
Saldo	359,1	109,1	109,1	109,1	109,1
Próximo vencimiento de Repo (20 de noviembre del 2009)					109,1
Vencimientos de Repo del del 30 de junio al 03 de julio del 2009					0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDR-BCRP)	<u>100,0</u> <u>100,0</u>		<u>100,0</u>		
Propuestas recibidas	315,0 180,0		222,0		
Plazo de vencimiento	3 m. 3 m.		3 m.		
Tasas de interés: Mínima	0,00 0,00		0,00		
Máxima	0,00 0,61		0,00		
Promedio	0,00 0,31		0,00		
Saldo	3 396,0	3 396,0	3 496,0	3 496,0	3 496,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (16 de julio del 2009)					177,0
Vencimientos de CDR BCRP del del 30 de junio al 03 de julio del 2009					0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	<u>--</u>	<u>--</u>	<u>--</u>	<u>--</u>	<u>--</u>
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)	<u>--</u>	<u>--</u>	<u>--</u>	<u>--</u>	<u>--</u>
Saldo	1 663,4	1 663,4	1 663,4	1 663,4	1 663,4
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (09 de Julio del 2009)					419,0
Vencimientos de CDBCRP del del 30 de junio al 03 de julio del 2009					0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)		<u>-20,0</u>	<u>0,0</u>	<u>-20,0</u>	<u>-30,0</u>
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		20,0	0,0	20,0	30,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
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	456,9	369,9	258,5	326,0	327,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0083%	0,0083%	0,0083%	0,0083%	0,0096%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<u>104,5</u>	<u>20,6</u>	<u>8,1</u>	<u>71,0</u>	<u>83,0</u>
Tasa de interés	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	352,4	349,3	250,4	255,0	244,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 959,1	2 938,7	2 915,9	2 895,2	2 875,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,9	6,9	6,8	6,8	6,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	817,9	797,6	774,8	754,0	734,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	1,9	1,8	1,8	1,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>384,0</u>	<u>760,5</u>	<u>449,5</u>	<u>579,5</u>	<u>951,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,25/3,01	2,95/3,05/3,00	3,00/3,00/3,00	3,00/3,05/3,00	2,95/3,05/3,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>23,0</u>	<u>45,0</u>	<u>47,1</u>	<u>81,2</u>	<u>85,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,20/0,26/0,23	0,20/0,28/0,23	0,20/0,28/0,24	0,20/0,28/0,23	0,20/0,25/0,24
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	<u>400,0</u>	<u>0,0</u>	<u>540,0</u>	<u>245,0</u>	<u>285,0</u>
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\$)	19 Junio	22 Junio	23 Junio	24 Junio	25 Junio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-59,2	-30,0	-33,2	102,0	-20,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-66,7	137,2	-50,3	49,5	-21,6
a. Mercado spot con el público	<u>27,5</u>	<u>77,1</u>	<u>-41,0</u>	<u>-1,0</u>	<u>-13,5</u>
i. Compras	162,9	197,8	109,6	202,9	172,8
ii. (-) Ventas	135,4	120,7	150,6	203,9	186,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	<u>77,6</u>	<u>-104,6</u>	<u>80,6</u>	<u>4,1</u>	<u>-19,1</u>
i. Pactadas	145,1	63,5	107,2	85,4	127,9
ii. (-) Vencidas	67,5	168,2	26,6	81,2	147,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<u>70,1</u>	<u>62,6</u>	<u>63,4</u>	<u>-48,4</u>	<u>-20,5</u>
i. Pactadas	73,3	100,9	69,4	38,5	74,9
ii. (-) Vencidas	3,1	38,3	6,0	86,9	95,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	879,0	1046,9	711,4	889,1	799,6
ii. A futuro	125,0	40,0	25,0	45,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<u>-62,7</u>	<u>-130,8</u>	<u>-22,9</u>	<u>1,0</u>	<u>-51,7</u>
i. Compras	1,9	36,0	1,1	79,4	94,9
ii. (-) Ventas	64,6	166,8	24,0	78,4	146,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>-95,9</u>	<u>61,1</u>	<u>-7,0</u>	<u>55,1</u>	<u>-8,0</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9830	3,0240	3,0243	3,0193	3,0250
(*) Datos preliminares					