

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

	06 Julio	07 Julio	08 Julio	09 Julio	10 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 600,2	1 670,8	1 728,3	2 676,0	2 310,7
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)	400,0	450,0	450,0	1 351,2	333,0 595,0 715,0 447,0
Propuestas recibidas	595,0	795,0	846,0	1 351,2	
Plazo de vencimiento	1d.	1d.	1d.	1d.	4 m. 3 m. 2 m. 3 d.
Tasas de interés: Mínima	2,96	2,92	2,85	2,52	-- -- 1,90 1,84
Máxima	3,00	2,92	2,85	3,00	-- -- 2,00 1,84
Promedio	2,97	2,92	2,85	2,80	-- -- 1,95 1,84
Saldo	4 965,8	4 315,8	4 165,8	4 351,0	3 499,8
Próximo vencimiento de CD BCRP (08 de julio del 2009)					300,0
Vencimientos de CD BCRP del 08 al 10 de julio del 2009					300,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	109,1	109,1	109,1	109,1	109,1
Próximo vencimiento de Repo (20 de noviembre del 2009)	109,1	109,1			109,1
Vencimientos de Repo del 08 al 10 de julio del 2009	0,0	0,0			0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDR-BCRP)			60,0		
Propuestas recibidas			120,0		
Plazo de vencimiento			3 m.		
Tasas de interés: Mínima			0,10		
Máxima			0,68		
Promedio			0,46		
Saldo	3 541,0	3 541,0	3 601,0	3 601,0	3 601,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (16 de julio del 2009)					177,0
Vencimientos de CDR BCRP del 08 al 10 de julio del 2009					177,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	--	--	--	--	--
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Saldo	1 663,4	1 663,4	1 663,4	1 244,4	1 244,4
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (09 de Julio del 2009)					913,9
Vencimientos de CDBCRP del 08 al 10 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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\$)	0,0	0,0	-19,4	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			19,4	0,0	0,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	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	1 200,2	1 220,8	1 218,3	1 324,8	1 810,7
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%	0,0116%	0,0116%	0,0072%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	2,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	2,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	40,0	100,9	33,0	45,1
Tasa de interés	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%	1,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 200,2	1 180,8	1 117,4	1 291,8	1 765,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 836,6	2 885,9	2 915,0	2 957,0	3 037,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,8	6,8	6,9	7,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	835,6	884,9	914,0	956,0	1 036,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,1	2,1	2,2	2,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	581,0	821,0	669,5	566,0	450,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,00/3,00	3,00/3,05/3,01	3,00/3,00/3,00	3,00/3,00/3,00	2,00/2,00/2,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	37,0	21,5	5,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,20/0,24/0,23	0,20/0,23/0,22	0,24/0,24/0,24	4,0	20,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	0,0	0,0	0,0	4,0	20,0
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\$)	03 Julio	06 Julio	07 Julio	08 Julio	09 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	34,1	4,6	-82,1	34,4	26,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	45,9	-74,2	21,3	75,8	3,1
a. Mercado spot con el público	24,4	-44,8	18,1	53,2	35,5
i. Compras	119,8	159,0	131,6	192,9	208,7
ii. (-) Ventas	95,4	203,7	113,5	139,7	173,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-9,7	45,0	-7,9	-8,0	-192,8
i. Pactadas	9,8	140,0	148,5	29,8	55,6
ii. (-) Vencidas	19,5	95,0	156,4	37,8	248,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	2,1	-33,8	95,5	33,5	-216,4
i. Pactadas	10,5	74,5	177,0	121,5	113,2
ii. (-) Vencidas	8,4	108,3	81,6	88,1	329,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	199,3	921,4	623,2	410,6	394,7
ii. A futuro	18,0	10,0	53,0	98,0	7,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-3,5	-1,2	-72,7	52,0	58,9
i. Compras	3,7	86,2	81,5	88,0	236,9
ii. (-) Ventas	7,2	87,4	154,2	36,0	178,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	14,0	-15,0	1,0	20,8	-10,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,0160	3,0212	3,0172	3,0284	3,0247
(*) Datos preliminares					