

| BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ | | | | | | | | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|---------|-------|----------|-------|--|
| RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS | | | | | | | | | | |
| (Millones de Nuevos Soles) | | | | | | | | | | |
| | 7 Junio | 8 Junio | 9 Junio | 10 Junio | 11 Junio | | | | | |
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 3 893,9 | 3 527,0 | 3 688,2 | 4 655,7 | 4 300,1 | | | | | |
| 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 | 484,8 | 1 500,0 | 1 754,7 | 2 216,6 | 1 500,0 | 1 811,5 | 500,1 | 500,0 | 2 300 | |
| Plazo de vencimiento | 1 084,8 | 1 769,5 | 1 754,7 | 2 221,7 | 2 438,9 | 1 811,5 | 005,0 | 1 924,0 | 2 715 | |
| Tasas de inte Mínima | 7 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 3 d. | 33 d. | 3 d. | |
| Máxima | 1,40 | 1,20 | 1,30 | 1,38 | 1,41 | 1,30 | 1,60 | 1,70 | 1,56 | |
| Promedio | 1,51 | 1,49 | 1,49 | 1,49 | 1,45 | 1,49 | 1,71 | 1,78 | 1,71 | |
| Saldo | 1,46 | 1,39 | 1,41 | 1,44 | 1,44 | 1,44 | 1,66 | 1,74 | 1,65 | |
| Próximo vencimiento de CD BCRP 14 de junio del 2010 | 16 392,0 | 16 646,7 | 17 108,6 | 16 853,4 | | | | 17 242,0 | | |
| Vencimientos de CD BCRP del 14 al 18 de junio del 2010 | | | | | | | | 5 634,9 | | |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | | | | | | | | 5 834,8 | | |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP) | | | | | | | | 0,0 | | |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | | | | 0,0 | | |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | | | | | | | | 0,0 | | |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera | | | | | | | | 259,7 | | |
| Próximo vencimiento de Repo (16 de agosto del 2010) | 259,7 | 259,7 | 259,7 | 259,7 | 259,7 | | | 50,0 | | |
| Vencimientos de REPO del 14 al 18 de junio del 2010 | | | | | | | | 0,0 | | |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| i. Compras (millones de US\$) | | | | | | | | 0,0 | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | | | | 0,0 | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | | | | | | 0,0 | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | | | | 0,0 | | |
| c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) | | | | | | | | 0,0 | | |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | | | | 0,0 | | |
| d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | | | | | | | | 0,0 | | |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | 0,0 | | |
| ii. Compras de BTP | | | | | | | | 0,0 | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 1 909,1 | 1 772,3 | 1 471,6 | 1 344,2 | 0,0 | | | | | |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | | | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0053% | 0,0053% | 0,0053% | 0,0053% | 0,0065% | | | | | |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | 2,30% | 2,30% | 2,30% | 2,30% | 2,55% | | | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | 2,30% | 2,30% | 2,30% | 2,30% | 2,55% | | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | | | | |
| Tasa de interés | 0,70% | 0,70% | 0,70% | 0,70% | 0,95% | | | | | |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 1 909,1 | 1 772,3 | 1 471,6 | 1 344,2 | 3 769,5 | | | | | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 4 022,1 | 4 016,2 | 3 978,2 | 3 935,1 | 3 769,5 | | | | | |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 8,0 | 8,0 | 7,9 | 7,8 | 7,6 | | | | | |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 1 819,5 | 1 813,6 | 1 775,6 | 1 732,4 | 1 574,9 | | | | | |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 3,6 | 3,6 | 3,5 | 3,5 | 3,2 | | | | | |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 456,0 | 470,0 | 342,8 | 456,0 | | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,45/1,50/1,50 | 1,45/1,50/1,49 | 1,45/1,50/1,49 | 1,40/1,50/1,49 | | | | | | |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 63,0 | 71,0 | 78,7 | 61,4 | | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,50/0,50/0,50 | 0,50/0,55/0,53 | 0,55/0,65/0,59 | 0,65/0,70/0,66 | | | | | | |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR | 521,0 | 0,0 | 0,0 | 89,4 | | | | | | |
| 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\$) | 4 Junio | 7 Junio | 8 Junio | 9 Junio | 10 Junio | | | | | |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 11,8 | 25,9 | -25,6 | -42,3 | 145,5 | | | | | |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 40,3 | 37,3 | -51,9 | -35,1 | 87,1 | | | | | |
| a. Mercado spot con el público | 57,5 | 66,1 | -43,3 | -33,3 | 90,4 | | | | | |
| i. Compras | 297,2 | 227,8 | 163,2 | 168,8 | 232,0 | | | | | |
| ii. (-) Ventas | 239,7 | 161,7 | 206,5 | 202,0 | 141,6 | | | | | |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -35,6 | -19,2 | 51,3 | -36,7 | -13,0 | | | | | |
| i. Pactadas | 17,2 | 38,5 | 124,8 | 44,7 | 94,4 | | | | | |
| ii. (-) Vencidas | 52,8 | 57,7 | 73,5 | 81,4 | 107,4 | | | | | |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -7,1 | -7,8 | 25,0 | -29,5 | -71,4 | | | | | |
| i. Pactadas | 59,0 | 85,9 | 113,3 | 45,4 | 11,7 | | | | | |
| ii. (-) Vencidas | 66,1 | 93,7 | 88,3 | 74,9 | 83,1 | | | | | |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | | | | | | |
| i. Al contado | 337,0 | 285,5 | 626,6 | 256,9 | 392,0 | | | | | |
| ii. A futuro | 35,0 | 10,0 | 43,0 | 46,0 | 57,5 | | | | | |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 5,1 | 5,3 | 12,9 | -4,9 | -33,6 | | | | | |
| i. Compras | 52,8 | 61,6 | 83,4 | 71,6 | 67,1 | | | | | |
| ii. (-) Ventas | 47,7 | 56,3 | 70,5 | 76,5 | 100,8 | | | | | |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -9,0 | 1,8 | -6,7 | -3,9 | 6,0 | | | | | |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,8498 | 2,8497 | 2,8476 | 2,8451 | 2,8455 | | | | | |
| (*) Datos preliminares | | | | | | | | | | |

d. = día(s)
s. = semana(s)
m. = mes(es)
a. = año(s)