

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

	12 Julio				13 Julio				14 Julio				15 Julio				16 Julio						
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 558,8				4 580,6				3 964,7				3 803,9				3 677,2						
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	1 499,9	700,0	4 100,0	400,0	799,9	795,6	2 000,0	999,8	50,0	400,0	1 199,9	1 850,0	800,0	100,0	400,0	800,0	1 074,1	50,0	150,0	500,0	457,2	1 400,1
Propuestas recibidas	1 173,5	2 876,0	1 484,0	4 102,6	605,0	1 370,7	795,6	2 289,2	1 412,2	112,5	723,0	1 449,8	2 015,1	1 360,9	200,0	613,0	864,9	1 074,1	150,0	475,0	800,0	557,2	2 020,4
Plazo de vencimiento	57 d.	28 d.	7 d.	1 d.	80 d.	31 d.	7 d.	1 d.	1 d.	149 d.	85 d.	7 d.	1 d.	1 d.	148 d.	84 d.	7 d.	1 d.	147 d.	83 d.	31 d.	7 d.	3 d.
Tasas de interés	2,05	2,00	1,94	1,78	2,12	1,98	1,97	1,78	1,67	2,35	1,99	1,97	1,63	1,89	2,35	1,99	1,93	1,85	2,37	2,11	1,99	1,95	1,60
Máxima	2,07	2,01	1,99	2,00	2,12	2,00	2,00	1,96	1,96	2,40	2,11	2,00	2,00	1,96	2,35	2,11	1,99	2,00	2,37	2,11	2,05	2,01	1,94
Promedio	2,07	2,00	1,98	1,91	2,12	2,00	1,99	1,91	1,93	2,39	2,04	1,98	1,89	1,92	2,35	2,08	1,97	1,93	2,37	2,11	2,01	2,00	1,90
Saldo	18 932,6				18 828,1				19 777,8				19 482,1				18 859,3						
Próximo vencimiento de CD BCRP (19 de julio de 2010)																	3 550,1						
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 23 julio de 2010																	9 102,9						
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																							
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0						
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)																							
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0						
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	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0						
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera																							
Saldo	259,7				259,7				259,7				259,7				259,7						
Próximo vencimiento de Repo (16 de agosto de 2010)																	50,0						
Vencimientos de REPO del 19 al 23 de julio de 2010																	0,0						
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0				0,0				1 389,6				426,1				0,0						
i. Compras (millones de US\$)									493,5				151,0				0,0						
Tipo de cambio promedio									2,8158				2,8218										
ii. Ventas (millones de US\$)																							
Tipo de cambio promedio																							
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0						
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público																							
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público																							
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	858,9				585,1				854,6				1 055,9				1 119,9						
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																							
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).																							
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0089%				0,0089%				0,0089%				0,0089%				0,0077%						
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																							
Tasa de interés	2,80%				2,80%				2,80%				2,80%				2,80%						
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																							
Tasa de interés	2,80%				2,80%				2,80%				2,80%				2,80%						
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0				196,8				15,0				14,0				146,0						
Tasa de interés	1,20%				1,20%				1,20%				1,20%				1,20%						
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	858,9				388,3				839,6				1 041,9				973,9						
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	4 903,7				4 723,7				4 601,7				4 609,5				4 424,5						
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,8				9,4				9,1				8,9				8,7						
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 727,5				2 547,6				2 425,6				2 333,3				2 248,4						
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,4				5,0				4,8				4,6				4,4						
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																							
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	443,0				287,5				183,0				423,5				332,0						
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,85/2,00/1,92				1,90/2,00/1,95				2,00/2,00/2,00				2,00/2,05/2,00				2,00/2,00/2,00						
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	106,5				186,5				119,9				228,9				253,9						
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,80/1,85/1,80				1,80/2,10/1,96				2,10/2,55/2,45				2,60/3,00/2,79				3,75/4,25/4,10						
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	266,6				284,0				164,3				132,1				539,0						
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\$)	9 Julio				12 Julio				13 Julio				14 Julio				15 Julio						
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	165,0				-30,4				128,9				-207,6				-21,3						
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	248,0				24,8				142,5				-242,5				81,9						
a. Mercado spot con el público	249,9				40,2				155,8				217,7				233,8						
i. Compras	376,8				277,5				304,3				340,3				378,8						
ii. (-) Ventas	126,9				237,3				148,5				122,6				145,0						
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-33,6				-64,4				-119,7				-15,6				-94,8						
i. Pactadas	107,1				115,2				251,3				157,4				148,8						
ii. (-) Vencidas	140,7				179,6				131,7				173,0				243,6						
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	49,4				-9,2				133,3				-50,5				8,4						
i. Pactadas	76,3				101,6				195,3				107,3				98,7						
ii. (-) Vencidas	26,9				110,9				62,0				157,8				90,3						
d. Operaciones cambiarias interbancarias																							
i. Al contado	389,3				443,8				317,5				865,3				440,2						
ii. A futuro	195,0				60,0				15,0				212,0				149,0						
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-96,9				-85,9				-68,8				12,5				-165,6						
i. Compras	25,6				90,0				61,1				157,7				71,9						
ii. (-) Ventas	122,5				175,9				129,8				145,1				237,5						
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-18,8				1,8				-14,1				-487,9				-139,6						
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																							
Tasa de interés																							
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8239				2,8232				2,8199				2,8151				2,8215						
(*) Datos preliminares																							

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