

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

| | 27 junio | 28 junio | 30 junio | 1 julio |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 6 057,6 | 6 306,7 | 6 291,7 | 5 762,4 |
| 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) | 100,0 | 50,0 100,0 | 30,0 | |
| Propuestas recibidas | 199,0 | 123,0 143,0 | 45,5 | |
| Plazo de vencimiento | 86 d | 168 d. 85 d. | 350 d | |
| Tasas de interés Mínima | 4,20 | 4,28 4,29 | 4,55 | |
| Máxima | 4,31 | 4,36 4,31 | 4,71 | |
| Promedio | 4,28 | 4,32 4,30 | 4,64 | |
| Saldo | 2 320,1 | 2 470,1 | 2 500,1 | 2 500,1 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011) | | | | 190,0 |
| Vencimientos de CD BCRP al 1 de julio del 2011 | | | | 0,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | | | | 2 500,0 |
| Propuestas recibidas | | | | 4 200,0 |
| Plazo de vencimiento | | | | 3 d |
| Tasas de interés Mínima | | | | 4,40 |
| Máxima | | | | 4,50 |
| Promedio | | | | 4,41 |
| Saldo | | | | 2 500,0 |
| Próximo vencimiento de Repo | | | | 2 500,0 |
| Vencimientos de Repo al 1 de julio del 2011 | | | | 2 500,0 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 8 809,9 | 8 809,9 | 8 809,9 | 8 809,9 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP (7 de julio de 2011) | | | | 200,0 |
| Vencimientos de CDV BCRP al 1 de julio de 2011 | | | | 200,0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | 3 400,1 | 3 600,0 | 3 329,2 | |
| Propuestas recibidas | 3 466,8 | 3 824,4 | 3 329,2 | |
| Plazo de vencimiento | 1 d | 2 d | 1 d | |
| Tasas de interés Mínima | 4,15 | 4,15 | 4,10 | |
| Máxima | 4,25 | 4,25 | 4,25 | |
| Promedio | 4,22 | 4,22 | 4,20 | |
| Saldo | 3 400,1 | 3 600,0 | 3 329,2 | |
| Próximo vencimiento de Depósitos (1 de julio de 2011). | | 3 600,0 | 3 329,2 | |
| Vencimientos de Depósitos al 1 de julio de 2011 | | | 0,0 | |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 2 375,0 | 2 075,0 | 2 075,0 | 2 075,0 |
| Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (12 de julio de 2011) | | | | 300,0 |
| Vencimientos de CDR BCRP al 1 de julio de 2011 | | | | 0,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 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 | 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 | | | | |
| 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 | 2 557,5 | 2 556,7 | 2 932,5 | 8 262,4 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0127% | 0,0127% | 0,0127% | 0,0127% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | |
| Tasa de interés | 5,05% | 5,05% | 5,05% | 5,05% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | 5,05% | 5,05% | 5,05% | 5,05% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 48,8 | 65,5 | 82,8 | |
| Tasa de interés | 3,45% | 3,45% | 3,45% | 3,45% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 2 508,7 | 2 491,2 | 3 219,8 | 8 262,4 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 8 674,5 | 5 536,6 | 5 560,9 | 11 307,8 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 14,0 | 8,9 | 9,0 | 16,0 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 5 629,1 | 2 491,2 | 5 400,0 | 8 262,4 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,1 | 4,0 | 4,1 | 11,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 372,5 | 237,5 | 347,0 | 353,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,25/4,25/4,25 | 4,25/4,25/4,25 | 4,25/4,40/4,36 | 4,25/4,45/4,36 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 98,6 | 135,0 | 79,0 | 42,2 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,20/0,20/0,20 | 0,20/0,25/0,20 | 0,20/0,20/0,20 | 0,30/0,30/0,30 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 297,0 | 587,5 | 275,5 | 314,5 |
| 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\$) | 24 Junio | 27 Junio | 28 Junio | 30 Junio |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 52,9 | 52,9 | -109,5 | 60,8 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 15,9 | 15,9 | -151,4 | -21,2 |
| a. Mercado spot con el público | -2,7 | -2,7 | -18,6 | -6,0 |
| i. Compras | 308,2 | 308,2 | 224,0 | 416,1 |
| ii. (-) Ventas | 310,9 | 310,9 | 242,6 | 422,1 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 96,6 | 96,6 | -31,8 | -12,5 |
| i. Pactadas | 126,6 | 126,6 | 62,2 | 107,9 |
| ii. (-) Vencidas | 30,0 | 30,0 | 94,0 | 120,4 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 59,7 | 59,7 | -73,7 | -94,6 |
| i. Pactadas | 71,9 | 71,9 | 73,7 | 102,3 |
| ii. (-) Vencidas | 12,2 | 12,2 | 147,4 | 196,9 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | |
| i. Al contado | 308,9 | 308,9 | 373,6 | 402,6 |
| ii. A futuro | 115,0 | 115,0 | 70,0 | 222,5 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 4,3 | 4,3 | 27,7 | 57,9 |
| i. Compras | 7,7 | 7,7 | 98,7 | 172,2 |
| ii. (-) Ventas | 3,4 | 3,4 | 71,0 | 114,2 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -3,5 | -3,5 | -107,1 | 3,3 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,7598 | 2,7582 | 2,7551 | 2,7484 |
| (*) Datos preliminares | | | | |

d. = día(s)

s. = semana(s)

m. = mes(es)

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera