

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

	18 julio	19 julio	20 julio	21 julio	22 julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 559,4	6 862,8	7 168,2	6 805,6	6 556,1
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	100,0	50,0	100,0	200,0	30,0
Plazo de vencimiento	282,9	179,4	307,1	523,2	115,0
Tasas de interés: Mínima	85 d	175 d.	84 d.	83 d	357 d.
Máxima	4,34	4,35	4,30	4,26	4,75
Promedio	4,34	4,47	4,32	4,32	4,79
Saldo	4,34	4,43	4,31	4,31	4,76
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de agosto de 2011)	3 070,1	3 220,1	3 420,1	3 650,1	3 650,1
Vencimientos de CD BCRP del 20 al 22 de julio del 2011	160,0	160,0	160,0	160,0	160,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de Repo del 20 al 22 de julio del 2011					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de octubre de 2011)	8 309,9	8 309,9	8 309,9	8 309,9	8 309,9
Vencimientos de CDV BCRP del 20 al 22 de julio de 2011	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 499,9	2 799,9	2 799,9	2 800,1	3 300,0
Plazo de vencimiento	3 636,5	4 090,4	4 033,8	3 536,9	3 562,6
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	3,90	3,99	3,97	3,99	3,97
Promedio	4,25	4,25	4,20	4,18	4,20
Saldo	4,18	4,14	4,14	4,12	4,10
Próximo vencimiento de Depósitos (20 de julio de 2011)	2 499,9	2 799,9	2 799,9	2 800,1	3 300,0
Vencimientos de Depósitos del 20 al 22 de julio de 2011	2 499,9			2 800,1	3 300,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (25 de julio de 2011)	1 425,0	1 425,0	1 425,0	1 425,0	1 425,0
Vencimientos de CDR BCRP del 20 al 22 de julio de 2011	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	156,1	531,0	41,1	268,1	0,0
Tipo de cambio promedio	57,0	194,0	15,0	98,0	
ii. Ventas (millones de US\$)	2,7390	2,7373	2,7380	2,7359	
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	5 115,6	4 444,0	4 209,4	4 043,6	3 256,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0128%	0,0128%	0,0128%	0,0128%	0,0141%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	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%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	573,6	7,3	116,5	106,1	33,8
	3,45%	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	4 542,0	4 436,7	4 092,9	3 937,5	3 222,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 960,9	9 934,6	9 662,5	9 545,5	9 397,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,9	15,9	15,5	15,3	15,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 025,5	6 749,9	6 628,2	6 501,4	6 352,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,1	11,0	10,6	10,4	10,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	395,0	295,0	253,0	190,0	391,0
	4,25/4,25/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,25	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	288,0	233,1	287,1	352,1	313,0
	0,30/0,30/0,30	0,30/0,30/0,30	0,25/0,30/0,29	0,25/0,30/0,29	0,30/0,30/0,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	9,0	5,0	5,0	49,3	0,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	15 Julio	18 Julio	19 Julio	20 Julio	21 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-82,0	-8,1	-176,9	-9,0	-2,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	142,7	-31,0	-286,6	29,9	-32,7
a. Mercado spot con el público	161,2	16,9	-89,8	42,0	62,2
i. Compras	399,9	214,6	248,7	246,7	250,0
ii. (-) Ventas	238,6	197,7	338,6	204,8	187,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-32,2	36,1	42,7	-14,1	-20,8
i. Pactadas	42,1	68,0	44,4	41,0	34,3
ii. (-) Vencidas	74,3	32,0	1,6	55,1	55,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	192,5	13,1	-67,0	24,8	-50,9
i. Pactadas	215,0	37,6	19,5	42,9	21,2
ii. (-) Vencidas	22,4	24,5	86,5	18,1	72,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	423,1	294,1	341,1	269,1	451,5
ii. A futuro	142,0	18,0	65,0	135,0	50,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-42,3	-4,3	83,2	-40,1	20,1
i. Compras	20,9	21,0	83,2	11,1	70,5
ii. (-) Ventas	63,1	25,3	0,0	51,3	50,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-28,1	-51,1	-195,2	-9,0	-98,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7414	2,7375	2,7368	2,7380	2,7353
(*) Datos preliminares					

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