

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	28 Mayo	29 Mayo	30 Mayo	31 Mayo	1 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	12 459.9	12 167.2	11 641.6	9 259.9	8 983.3
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 (CD BCRP)	100.0 100.0	50.0 100.0	100.0 100.0	50.0	
Propuestas recibidas	486,5 341,0	198,3 330,0	150,0 261,0	122,0	
Plazo de vencimiento	92 d 183 d	182 d 91 d	90 d 43 d	343 d	
Tasas de interés Mínima	4,18 4,20	4,20 4,18	4,18 4,18	4,21	
Máxima	4,19 4,24	4,23 4,19	4,24 4,23	4,25	
Promedio	4,19 4,23	4,21 4,19	4,22 4,21	4,24	
Saldo	21 190,9	21 340,9	21 540,9	21 590,9	21 590,9
Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de junio de 2012)		1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 8 de junio de 2012		0,0			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 985,0	5 521,4	4 342,6	2 100,1	
Propuestas recibidas	4 985,0	5 521,4	4 342,6	2 316,6	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de interés Mínima	4,20	4,20	4,21	4,13	
Máxima	4,25	4,25	4,25	4,24	
Promedio	4,22	4,23	4,23	4,18	
Saldo	4 985,0	5 521,4	4 342,6	2 100,1	
Próximo vencimiento de Depósitos (1 de junio de 2012)	4 985,0		4 342,6		
Vencimientos de Depósitos del 4 al 8 de junio de 2012	4 985,0		4 342,6		
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)	170,0	200,0	200,0		
Propuestas recibidas	460,0	280,0	280,0		
Plazo de vencimiento	59 d	61 d	61 d		
Tasas de interés Mínima	1,95	1,75	1,75		
Máxima	2,00	1,78	1,78		
Promedio	1,97	1,77	1,77		
Saldo	1 320,0	1 320,0	1 520,0		
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (23 de julio de 2012)		780,0	780,0		
Vencimientos de CDR BCRP del 4 al 8 de junio de 2012		0,0	0,0		
vii. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	12,0	2,0			
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de REPO del 31 de mayo al 1 de junio de 2012					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	-310,6	-763,0	-750,9	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)		115,0	282,0	277,0	0,0
Tipo de cambio promedio		2,7013	2,7058	2,7108	
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	7 104,9	6 185,2	6 135,9	6 358,9	12 483,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0130%	0,0130%
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	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	7 104,9	6 185,2	6 135,9	6 556,4	12 483,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 682,9	12 682,9	12 682,9	12 682,9	15 929,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	27,3	27,3	27,3	27,3	26,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 237,4	9 009,7	9 009,7	8 819,8	12 483,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19,9	19,9	19,9	19,9	20,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	728,7	754,3	927,7	1 045,5	678,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,13/4,25/4,24	4,15/4,25/4,24	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,25	4,15/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	126,9	93,9	35,6	3,0	58,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,00/2,00	1,00/1,00/1,00	0,50/1,00/0,64	1,75/1,75/1,75	2,50/2,50/2,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	86,0	22,0	42,5	612,6	1 458,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		10,0/4,20			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			20,0/4,20		20,0 / 4,23
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					