

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	4 Junio	5 Junio	6 Junio	7 Junio	8 Junio
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>9 102.5</b>	<b>9 252.6</b>	<b>9 209.8</b>	<b>9 327.6</b>	<b>9 318.4</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas		50.0		50.0	
Plazo de vencimiento		228.0		176.0	
Tasas de interés		189 d		371 d	
Mínima		4.20		4.19	
Máxima		4.21		4.22	
Promedio		4.20		4.21	
Saldo	21 590.9	21 640.9	21 640.9	21 690.9	21 690.9
Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de junio de 2012)	1 100.0	1 100.0	1 100.0	1 100.0	1 100.0
Vencimientos de CD BCRP del 11 al 15 de junio de 2012					2 450.0
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</b>	<b>2 090.0</b>	<b>1 500.0</b>			
Propuestas recibidas	2 090.0	2 105.0			
Plazo de vencimiento		1 d			
Tasas de interés		4.25			
Mínima		4.25			
Máxima		4.25			
Promedio		4.25			
Saldo	2 090.0	1 500.0			
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de Repo del 11 al 15 de junio de 2012					
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>					
Tipo de cambio promedio					
<b>ii. Ventas (millones de US\$)</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>
Tipo de cambio promedio					
<b>c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
<b>d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>	<b>0.0</b>
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>11 192.5</b>	<b>10 702.6</b>	<b>9 209.8</b>	<b>9 277.6</b>	<b>9 318.4</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
<b>a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</b>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0130%	0.0130%	0.0131%	0.0131%	0.0143%
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>					
Tasa de interés	5.05%	5.05%	5.05%	5.05%	5.05%
<b>c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	5.05%	5.05%	5.05%	5.05%	5.05%
<b>d. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	101.2	55.2	550.0	940.5	940.5
Tasa de interés	3.45%	3.45%	3.45%	3.45%	3.45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>11 091.3</b>	<b>10 647.4</b>	<b>9 209.8</b>	<b>8 727.6</b>	<b>8 377.9</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	<b>12 682.9</b>	<b>12 682.9</b>	<b>15 282.8</b>	<b>15 282.8</b>	<b>14 850.4</b>
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>27.3</b>	<b>27.3</b>	<b>20.1</b>	<b>20.1</b>	<b>19.5</b>
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	<b>12 483.2</b>	<b>12 135.3</b>	<b>11 837.7</b>	<b>11 837.7</b>	<b>11 405.2</b>
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>19.9</b>	<b>19.9</b>	<b>15.6</b>	<b>15.6</b>	<b>15.0</b>
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>	<b>884.0</b>	<b>945.3</b>	<b>1 026.2</b>	<b>1 031.0</b>	<b>912.5</b>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,25	4,10/4,25/4,23	4,00/4,25/4,21	4,10/4,25/4,21	4,10/4,25/4,23
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	<b>159.1</b>	<b>263.5</b>	<b>401.3</b>	<b>420.4</b>	<b>394.4</b>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,50/2,50/2,50	1,50/2,50/2,15	2,45/2,50/2,50	2,45/2,55/2,50	2,45/2,55/2,50
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</b>	<b>605.6</b>	<b>107.0</b>	<b>32.3</b>	<b>1 041.0</b>	<b>1 060.4</b>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			20,0/4,20		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>01 Junio</b>	<b>04 Junio</b>	<b>05 Junio</b>	<b>06 Junio</b>	<b>07 Junio</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-96.5	-68.6	68.9	-8.3	53.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-112.0	-434.7	42.8	-60.5	94.4
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>-33.3</b>	<b>-146.0</b>	<b>90.3</b>	<b>-36.2</b>	<b>112.6</b>
i. Compras	360.8	237.9	271.2	209.2	365.0
ii. (-) Ventas	444.1	383.9	180.9	245.5	252.5
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>95.6</b>	<b>87.5</b>	<b>-22.0</b>	<b>29.8</b>	<b>-129.2</b>
i. Pactadas	187.0	160.0	90.1	158.0	147.5
ii. (-) Vencidas	91.4	72.5	112.2	128.2	276.8
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>80.1</b>	<b>-278.6</b>	<b>-48.2</b>	<b>-22.5</b>	<b>-88.0</b>
i. Pactadas	142.0	29.9	107.7	25.5	263.7
ii. (-) Vencidas	61.9	308.5	155.9	47.9	351.7
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>					
i. Al contado	698.0	486.5	852.5	1216.9	1129.0
ii. A futuro	90.0	131.0	105.0	150.5	170.0
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</b>	<b>-52.3</b>	<b>-52.6</b>	<b>3.2</b>	<b>-96.6</b>	<b>54.2</b>
i. Compras	27.4	18.7	109.9	26.6	327.3
ii. (-) Ventas	89.7	71.4	106.7	123.2	273.1
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	<b>4.1</b>	<b>-0.1</b>	<b>-7.0</b>	<b>-8.0</b>	<b>2.5</b>
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7079	2.7034	2.7012	2.6821	2.6747

(\*) Datos preliminares