

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
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 102.5	9 252.6	9 209.8	9 327.6	9 318.4
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 (CD BCRP)					
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
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	2 090.0	1 500.0			
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. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	11 192.5	10 702.6	9 209.8	9 277.6	9 318.4
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%	0.0131%	0.0131%	0.0143%
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	101.2	55.2	550.0	940.5	940.5
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	11 091.3	10 647.4	9 209.8	8 727.6	8 377.9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	12 682.9	12 682.9	15 282.8	15 282.8	14 850.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	27.3	27.3	20.1	20.1	19.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	12 483.2	12 135.3	11 837.7	11 837.7	11 405.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	15.6	15.6	15.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	884.0	945.3	1 026.2	1 031.0	912.5
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. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	159.1	263.5	401.3	420.4	394.4
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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	605.6	107.0	32.3	1 041.0	1 060.4
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			20,0/4,20		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	01 Junio	04 Junio	05 Junio	06 Junio	07 Junio
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
a. Mercado spot con el público	-33.3	-146.0	90.3	-36.2	112.6
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. Compras forward al público (con y sin entrega)	95.6	87.5	-22.0	29.8	-129.2
i. Pactadas	187.0	160.0	90.1	158.0	147.5
ii. (-) Vencidas	91.4	72.5	112.2	128.2	276.8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	80.1	-278.6	-48.2	-22.5	-88.0
i. Pactadas	142.0	29.9	107.7	25.5	263.7
ii. (-) Vencidas	61.9	308.5	155.9	47.9	351.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
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
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-52.3	-52.6	3.2	-96.6	54.2
i. Compras	27.4	18.7	109.9	26.6	327.3
ii. (-) Ventas	89.7	71.4	106.7	123.2	273.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4.1	-0.1	-7.0	-8.0	2.5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7079	2.7034	2.7012	2.6821	2.6747
(*) Datos preliminares					