

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	11 Junio	12 Junio	13 Junio	14 Junio	15 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	9 563.7	10 435.6	10 361.4	11 136.0	10 455.6
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	200.0	50.0	100.0	50.0	100.0
Plazo de vencimiento	519.0	323.7	291.0	225.0	104.0
Tasas de interés	92 d	182 d	92 d	364 d	91 d
Minima	4.19	4.20	4.18	4.20	4.18
Maxima	4.20	4.20	4.19	4.21	4.25
Promedio	4.19	4.20	4.19	4.21	4.20
Saldo	21 890.9	20 840.9	20 940.9	19 740.9	19 740.9
Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de julio de 2012)		1 350.0		1 490.0	1 490.0
Vencimientos de CD BCRP del 18 al 22 de junio de 2012		1 350.0			0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1 400.0	1 500.0	1 200.0	2 083.3	1 299.9
Propuestas recibidas	2 353.5	2 445.2	2 053.4	2 083.3	2 473.7
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	3 d	3 d
Tasas de interés	3.90	4.00	4.00	4.00	4.00
Minima	4.15	4.13	4.09	4.23	4.05
Maxima	4.08	4.09	4.08	4.10	4.05
Promedio	4.00	4.00	4.00	4.00	4.00
Saldo	1 400.0	1 500.0	1 200.0	2 083.3	1 299.9
Próximo vencimiento de Depósitos (18 de junio de 2012)					1 299.9
Vencimientos de Depósitos del 18 al 22 de junio de 2012					1 299.9
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Minima					
Maxima					
Promedio					
Saldo	1 520.0				
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (23 de julio de 2012)	780.0	780.0	780.0	780.0	780.0
Vencimientos de CDR BCRP del 18 al 22 de junio de 2012	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US\$)					
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	7 963.7	8 885.6	9 061.4	8 902.7	9 155.7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0131%	0.0131%	0.0131%	0.0132%	0.0132%
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	60.0	60.0	60.0	0.0	72.0
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	7 903.7	8 825.6	8 992.4	8 902.7	9 083.7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	14 463.1	13 460.0	13 360.9	13 289.9	13 239.1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.0	17.6	17.5	17.4	17.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11 018.0	10 014.9	9 915.7	9 844.7	9 794.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14.5	13.1	13.0	12.9	12.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 125.5	917.6	898.6	881.6	1 173.6
Tasas de interés: Minima / Maxima / Promedio	4,10/4,25/4,19	4,20/4,25/4,25	4,10/4,25/4,22	4,10/4,25/4,23	4,15/4,30/4,24
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	253.0	62.5	10.6	123.7	149.6
Tasas de interés: Minima / Maxima/ Promedio	2,50/2,50/2,50	2,00/2,00/2,00	1,25/1,25/1,25	1,15/1,15/1,15	1,00/1,15/1,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	923.9	518.5	290.3	20.0	60.0
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\$)	08 Junio	11 Junio	12 Junio	13 Junio	14 Junio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-54.5	89.2	-31.7	40.0	50.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-6.4	87.7	-10.9	119.2	-0.8
a. Mercado spot con el público	44.0	105.8	-10.4	122.1	-2.4
i. Compras	337.5	269.5	234.6	291.3	249.3
ii. (-) Ventas	293.5	163.8	245.0	169.3	251.7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-63.8	1.8	69.8	-77.2	-61.7
i. Pactadas	94.1	158.4	244.1	105.7	157.0
ii. (-) Vencidas	157.9	156.5	174.3	182.8	218.7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-15.7	0.3	90.7	2.0	-112.8
i. Pactadas	94.8	91.7	268.2	247.7	124.7
ii. (-) Vencidas	110.5	91.4	177.5	245.6	237.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	698.4	962.9	1239.3	976.7	1473.8
ii. A futuro	170.0	95.0	181.0	149.0	220.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-97.6	-87.2	2.8	66.2	19.2
i. Compras	52.1	66.7	173.8	244.6	230.3
ii. (-) Ventas	149.8	153.9	171.1	178.4	211.1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.2	4.0	0.0	-6.2	1.3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.6838	2.6813	2.6849	2.6767	2.6701
(*) Datos preliminares					