

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

| | 2 Julio | 3 Julio | 4 Julio | 5 Julio | 6 Julio |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 8 650.4 | 8 793.2 | 8 755.0 | 8 801.6 | 8 756.0 |
| 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 | | 417.0 | | 241.0 | |
| Tasas de interés: Mínima | | 189 d | | 371 d | |
| Máxima | | 4.10 | | 4.00 | |
| Promedio | | 4.15 | | 4.13 | |
| Saldo | 20 690.9 | 20 740.9 | 20 740.9 | 20 790.9 | 20 790.9 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de julio de 2012) | | 1 490.0 | 1 490.0 | 1 490.0 | 1 490.0 |
| Vencimientos de CD BCRP del 9 al 13 de julio de 2012 | | | | | 1 490.0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 3 000.0 | 3 000.0 | 3 500.1 | 4 150.0 | 5 000.0 |
| Plazo de vencimiento | 4 580.0 | 5 450.0 | 5 930.0 | 6 581.0 | 8 331.2 |
| Tasas de interés: Mínima | 1 d | 1 d | 1 d | 1 d | 3 d |
| Máxima | 4.25 | 4.28 | 4.33 | 4.33 | 4.31 |
| Promedio | 4.31 | 4.33 | 4.39 | 4.39 | 4.40 |
| Saldo | 4.27 | 4.30 | 4.35 | 4.34 | 4.34 |
| Próximo vencimiento de Repo (9 de julio de 2012) | | 3 000.0 | 3 500.1 | 4 150.0 | 5 000.0 |
| Vencimientos de Repo del 9 al 13 de julio de 2012 | | 3 000.0 | 3 000.0 | 5 000.0 | 5 000.0 |
| v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Próximo vencimiento de Depósitos. | | | | | |
| Vencimientos de Depósitos del 9 al 13 de julio de 2012 | | | | | |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 1 520.0 | 1 520.0 | 1 520.0 | 1 520.0 | 1 520.0 |
| Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (23 de julio de 2012) | | 780.0 | 780.0 | 780.0 | 780.0 |
| Vencimientos de CDR BCRP del 9 al 13 de julio de 2012 | | 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 | 11 650.4 | 11 743.2 | 12 255.0 | 12 901.6 | 14 256.0 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0.0136% | 0.0133% | 0.0133% | 0.0133% | 0.0133% |
| 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 | 5.05% | 5.05% | 5.05% | 5.05% | 5.05% |
| Tasa de interés | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 3.45% | 3.45% | 3.45% | 3.45% | 3.45% |
| Tasa de interés | | | | | |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 11 650.4 | 11 743.2 | 12 255.0 | 12 901.6 | 14 256.0 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 12 324.4 | 12 091.6 | 13 141.9 | 13 767.1 | 14 412.8 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 17.2 | 15.9 | 17.2 | 18.1 | 18.9 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 8 879.3 | 8 706.4 | 9 756.7 | 10 381.9 | 11 027.6 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 12.4 | 11.4 | 12.8 | 13.6 | 14.5 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 676.0 | 1 046.1 | 853.3 | 772.3 | 1 014.5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,25/4,25/4,25 | 4,25/4,25/4,25 | 4,20/4,30/4,25 | 4,20/4,33/4,27 | 3,90/4,40/4,29 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 111.4 | 59.0 | 77.2 | 49.1 | 78.0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,45/1,00/0,65 | 0,50/1,00/0,86 | 1,00/1,00/1,00 | 1,00/1,00/1,00 | 1,00/1,00/1,00 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 502.1 | 1 118.6 | 1 488.5 | 1 271.0 | 1 294.9 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 9,5 / 4,17 | 32,0 / 4,25 | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 28 Junio | 02 Julio | 03 Julio | 04 Julio | 05 Julio |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 109.7 | -18.8 | -107.0 | 82.2 | 123.1 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 184.5 | -71.1 | -48.7 | 52.0 | 79.2 |
| a. Mercado spot con el público | 173.1 | -64.4 | -26.2 | 52.5 | 75.7 |
| i. Compras | 508.3 | 294.6 | 228.0 | 218.4 | 264.7 |
| ii. (-) Ventas | 335.2 | 359.0 | 254.2 | 165.9 | 189.0 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 82.9 | -33.4 | -16.2 | 0.4 | -44.8 |
| i. Pactadas | 218.6 | 213.2 | 29.1 | 1.6 | 190.7 |
| ii. (-) Vencidas | 135.6 | 246.6 | 45.2 | 1.3 | 235.5 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 157.8 | -85.7 | 42.2 | -29.9 | -88.7 |
| i. Pactadas | 322.8 | 105.7 | 97.7 | 4.3 | 165.5 |
| ii. (-) Vencidas | 165.0 | 191.4 | 55.5 | 34.1 | 254.2 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 960.5 | 802.8 | 865.1 | 499.1 | 673.2 |
| ii. A futuro | 323.5 | 213.0 | 242.0 | 110.0 | 255.0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 43.6 | -55.7 | -5.1 | 33.6 | 18.3 |
| i. Compras | 162.9 | 171.4 | 34.4 | 34.0 | 249.1 |
| ii. (-) Ventas | 119.3 | 227.0 | 39.5 | 0.4 | 230.7 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -2.8 | -6.2 | -7.2 | -1.3 | 3.9 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2.6709 | 2.6516 | 2.6452 | 2.6452 | 2.6463 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |