

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	23 Julio	24 Julio	25 Julio	26 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	11.075.3	10.869.8	11.210.5	11.230.1
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	100.0	50,0 100,0	100.0	50,0 50,0
Plazo de vencimiento	374.0	280.2 370.6	259.5	141.0 160.0
Tasas de interés Mínima	353 d	168 d 254 d	351 d	350 d 252 d
Máxima	3.98	3.95 3.97	3.98	3.98 3.99
Promedio	4.01	3.98 4.00	4.01	4.01 4.01
Saldo	4.00	3.96 3.98	4.00	4.00 4.00
Saldo	18.551.0	18.701.0	18.801.0	18.901.0
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de agosto de 2012)				1.620.1
Vencimientos de CD BCRP del 30 de julio al 3 de agosto de 2012				0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas	3.700.0	4.100.0	3.999.9	4.000.0
Plazo de vencimiento	4.401.2	4.592.8	5.404.1	4.993.5
Tasas de interés Mínima	1 d	1 d	1 d	4 d
Máxima	4.00	4.05	4.10	4.10
Promedio	4.20	4.22	4.20	4.18
Saldo	4.14	4.17	4.18	4.16
Saldo	3.700.0	4.100.0	3.999.9	4.000.0
Próximo vencimiento de Depósitos (30 de julio de 2012).				4.000.0
Vencimientos de Depósitos del 30 de julio al 3 de agosto de 2012				4.000.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	740.0	740.0	370.0	200.0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (30 de julio de 2012)				200.0
Vencimientos de CDR BCRP del 30 de julio al 3 de agosto de 2012				200.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	7.275.3	6.619.8	7.110.6	7.130.1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0132%	0.0133%	0.0133%	0.0138%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	120.0
Tasa de interés	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	7.275.3	6.619.8	7.110.6	7.010.1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	15.196.9	15.196.9	15.196.9	13.079.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	19.9	19.9	19.9	17.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	10.239.7	9.902.4	9.765.6	9.659.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15.4	15.4	15.4	12.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1.208.6	1.345.0	785.0	1.013.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,24	4,20/4,30/4,24	4,15/4,25/4,25	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	49.8	106.7	207.7	44.7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,25/0,21	0,15/0,25/0,21	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	44.3	79.8	25.0	10.7
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		40,0 / 3,96	10,0 / 3,96	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				10,7 / 4,00
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Julio	23 Julio	24 Julio	25 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	87.0	-60.1	40.4	-5.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	85.8	-190.6	9.5	-210.4
a. Operaciones spot con el público	92.7	97.7	12.9	-54.3
i. Compras	377.8	327.5	239.4	245.0
ii. (-) Ventas	285.0	229.8	226.5	299.3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	80.3	25.3	-4.8	68.6
i. Pactadas	131.9	192.0	81.1	169.5
ii. (-) Vencidas	51.7	166.8	86.0	100.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	79.0	-105.2	-35.8	-136.5
i. Pactadas	111.5	142.4	274.7	94.6
ii. (-) Vencidas	32.5	247.5	310.5	231.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	1089.9	869.4	1051.1	781.2
ii. A futuro	139.0	350.0	210.0	128.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-34.2	90.3	220.1	121.9
i. Compras	12.7	244.5	302.4	221.3
ii. (-) Ventas	46.8	154.2	82.4	99.3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	8.0	-297.7	1.0	-147.8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.6333	2.6542	2.6388	2.6379
(*) Datos preliminares				