

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ**  
**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Nuevos Soles)

	21 Setiembre	22 Setiembre	23 Setiembre	24 Setiembre	25 Setiembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>1 188,6</b>	<b>1 159,3</b>	<b>1 362,8</b>	<b>2 289,9</b>	<b>2 570,6</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 (CDBCRP)</b>	<b>900,1</b>	<b>900,0</b>	<b>1 800,0</b>	<b>200,0</b> <b>1 965,9</b>	<b>400,0</b> <b>1 840,9</b>
Propuestas recibidas	955,2	962,9	1 978,5	809,0	1 965,9
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	1 d.	4 m.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	1,09	1,05	1,05	1,20	1,05
Máxima	1,23	1,23	1,20	1,25	1,23
Promedio	1,19	1,18	1,14	1,23	1,13
Saldo	9 556,7	9 556,6	10 456,6	10 822,5	11 097,5
Próximo vencimiento de CD BCRP (28 de setiembre del 2009)					1 840,9
Vencimientos de CD BCRP del 28 de setiembre al 2 de octubre del 2009					1 840,9
<b>ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</b>					
Saldo	109,1	109,1	109,1	109,1	109,1
Próximo vencimiento de Repo (20 de noviembre del 2009)					109,1
Vencimientos de CD BCRP del 28 de setiembre al 2 de octubre del 2009					0,0
<b>iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)</b>					
Saldo	455,0	455,0	455,0	455,0	305,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP (28 de setiembre del 2009)					200,0
Vencimientos de CDR BCRP del 28 de setiembre al 2 de octubre del 2009					245,0
<b>iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>					
Saldo	--	--	--	--	--
<b>v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</b>					
Saldo	330,5	330,5	330,5	330,5	230,5
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (20 de noviembre del 2009)					230,5
Vencimientos de CD BCRP del 28 de setiembre al 2 de octubre del 2009					0,0
<b>vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</b>					
Propuestas recibidas					37,0
Plazo de vencimiento					87,0
Tasas de interés: Mínima					1 a.
Máxima					1,30
Promedio					1,51
Saldo	234,8	234,8	234,8	234,8	1,46
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)					271,8
Vencimientos de Repo del 28 de setiembre al 2 de octubre del 2009					39,8
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>772,8</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>269,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
Tipo de cambio promedio			2,8729		
<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>
<b>i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</b>					
<b>ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</b>					
<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>
<b>i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</b>					
<b>ii. Compras de BTP</b>					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>413,5</b>	<b>387,3</b>	<b>453,2</b>	<b>267,0</b>	<b>510,7</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)	0,0052%	0,0052%	0,0053%	0,0054%	0,0053%
<b>b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</b>					
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
<b>c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
<b>d. Depósitos Overnight en moneda nacional</b>					
Tasa de interés	41,1	58,6	90,5	137,8	267,5
	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>372,4</b>	<b>328,7</b>	<b>362,7</b>	<b>129,2</b>	<b>243,2</b>
<b>a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)</b>	<b>2 957,1</b>	<b>2 938,7</b>	<b>2 923,3</b>	<b>2 899,5</b>	<b>2 882,2</b>
<b>b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>6,9</b>	<b>6,9</b>	<b>6,8</b>	<b>6,8</b>	<b>6,7</b>
<b>c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)</b>	<b>734,2</b>	<b>715,7</b>	<b>700,4</b>	<b>676,6</b>	<b>659,2</b>
<b>d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)</b>	<b>1,7</b>	<b>1,7</b>	<b>1,6</b>	<b>1,6</b>	<b>1,5</b>
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
<b>a. Operaciones a la vista en moneda nacional</b>	<b>718,0</b>	<b>394,0</b>	<b>68,4</b>	<b>141,0</b>	<b>73,0</b>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,15/1,25/1,22	1,15/1,25/1,22	1,05/1,20/1,17	1,05/1,25/1,11	1,00/1,10/1,03
<b>b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</b>	<b>37,5</b>	<b>37,5</b>	<b>31,5</b>	<b>82,5</b>	<b>138,0</b>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,22/0,22/0,22	0,22/0,22/0,22	0,22/0,22/0,22	0,20/0,22/0,20	0,20/0,23/0,21
<b>c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</b>	<b>151,5</b>	<b>50,0</b>	<b>60,0</b>	<b>70,0</b>	<b>20,0</b>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
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>18 Setiembre</b>	<b>21 Setiembre</b>	<b>22 Setiembre</b>	<b>23 Setiembre</b>	<b>24 Setiembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-54,6	-9,3	88,0	-147,0	33,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-27,4	-103,9	-113,4	-267,8	24,7
<b>a. Mercado spot con el público</b>	<b>4,4</b>	<b>-39,7</b>	<b>-94,4</b>	<b>-2,1</b>	<b>19,1</b>
<b>i. Compras</b>	<b>187,2</b>	<b>178,9</b>	<b>119,6</b>	<b>221,0</b>	<b>154,7</b>
<b>ii. (-) Ventas</b>	<b>182,8</b>	<b>218,6</b>	<b>214,0</b>	<b>223,1</b>	<b>135,7</b>
<b>b. Compras forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>180,4</b>	<b>126,8</b>	<b>335,8</b>	<b>256,7</b>	<b>-195,5</b>
<b>i. Pactadas</b>	<b>210,1</b>	<b>146,7</b>	<b>423,2</b>	<b>336,0</b>	<b>79,4</b>
<b>ii. (-) Vencidas</b>	<b>29,7</b>	<b>19,9</b>	<b>87,3</b>	<b>79,3</b>	<b>274,8</b>
<b>c. Ventas forward al público (con y sin entrega)</b>	<b>207,6</b>	<b>32,2</b>	<b>134,4</b>	<b>135,9</b>	<b>-204,4</b>
<b>i. Pactadas</b>	<b>291,9</b>	<b>124,0</b>	<b>244,9</b>	<b>177,2</b>	<b>186,0</b>
<b>ii. (-) Vencidas</b>	<b>84,2</b>	<b>91,8</b>	<b>110,5</b>	<b>41,3</b>	<b>390,5</b>
<b>d. Operaciones cambiarias interbancarias</b>					
<b>i. Al contado</b>	<b>312,3</b>	<b>364,1</b>	<b>416,5</b>	<b>413,9</b>	<b>321,8</b>
<b>ii. A futuro</b>	<b>55,0</b>	<b>63,0</b>	<b>25,0</b>	<b>66,0</b>	<b>11,0</b>
<b>e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entreg</b>	<b>57,7</b>	<b>73,8</b>	<b>33,1</b>	<b>-35,2</b>	<b>117,3</b>
<b>i. Compras</b>	<b>83,5</b>	<b>90,2</b>	<b>110,0</b>	<b>41,1</b>	<b>389,9</b>
<b>ii. (-) Ventas</b>	<b>25,8</b>	<b>16,4</b>	<b>76,8</b>	<b>76,3</b>	<b>272,6</b>
<b>f. Operaciones netas con otras instituciones financieras</b>	<b>-35,0</b>	<b>-66,1</b>	<b>-29,0</b>	<b>-268,5</b>	<b>4,0</b>
<b>g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</b>					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8948	2,9015	2,8890	2,8712	2,8778
(*) Datos preliminares					