

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

	5 Octubre	6 Octubre	7 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 142,6	2 235,6	2 181,8
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones			
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>			
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>	<u>200,0</u> <u>869,7</u>	<u>250,0</u> <u>999,9</u>	<u>400,0</u> <u>950,4</u>
Propuestas recibidas	568,0 904,7	552,0 1 417,4	402,1 950,4
Plazo de vencimiento	31 d. 1 d.	31 d. 1 d.	33 d. 5 d.
Tasas de interés: Mínima	1,21 1,12	1,22 1,09	1,22 1,15
Máxima	1,25 1,23	1,24 1,23	1,28 1,25
Promedio	1,24 1,16	1,23 1,17	1,24 1,18
Saldo	11 726,3	12 106,5	12 457,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (12 de octubre del 2009)			1 350,4
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de octubre del 2009			2 700,3
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>			
Saldo	109,1	109,1	109,1
Próximo vencimiento de Repo (20 de noviembre del 2009)			109,1
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de octubre del 2009			0,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)</u>			
Saldo	60,0	60,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP			0,0
Vencimientos de CDR BCRP del 12 al 16 de octubre del 2009			0,0
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	--	--	--
Saldo	0,0	0,0	0,0
v. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</u>			
Saldo	230,5	230,5	230,5
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (20 de noviembre del 2009)			230,5
Vencimientos de CD BCRP del 12 al 16 de octubre del 2009			0,0
vi. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u>			
Saldo	271,8	271,8	271,8
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)			39,8
Vencimientos de Repo del 12 al 16 de octubre del 2009			0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	<u>0,0</u>	<u>114,6</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>		40,0	
Tipo de cambio promedio		2,8653	
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio			
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>			
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>			
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>			
ii. <u>Compras de BTP</u>			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 128,9	1 133,3	911,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0053%	0,0053%	0,0053%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>			
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>			
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	0,0	29,0	37,0
Tasa de interés	0,45%	0,45%	0,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 128,9	1 104,3	874,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S./) (*)	3 403,2	3 383,0	3 335,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,0	8,0	7,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S./)	1 225,3	1 205,1	1 157,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,8	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>275,0</u>	<u>248,0</u>	<u>377,5</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,10/1,20/1,15	1,10/1,15/1,15	1,10/1,15/1,15
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>59,8</u>	<u>96,0</u>	<u>128,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,21/0,22/0,21	0,21/0,24/0,22	0,22/0,35/0,27
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
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\$)	2 Octubre	5 Octubre	6 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-0,8	1,5	56,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-92,0	-89,7	-1,3
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>-54,9</u>	<u>-93,9</u>	<u>40,3</u>
i. Compras	201,5	127,5	169,4
ii. (-) Ventas	256,4	221,4	129,1
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>180,5</u>	<u>134,8</u>	<u>2,9</u>
i. Pactadas	245,9	236,3	128,8
ii. (-) Vencidas	65,4	101,5	125,9
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>89,2</u>	<u>43,7</u>	<u>-54,9</u>
i. Pactadas	131,6	116,2	72,9
ii. (-) Vencidas	42,4	72,5	127,8
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>			
i. Al contado	398,5	228,2	258,0
ii. A futuro	51,0	31,0	54,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-32,3</u>	<u>-31,7</u>	<u>0,4</u>
i. Compras	29,2	67,3	124,9
ii. (-) Ventas	61,5	99,1	124,5
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>-27,9</u>	<u>7,0</u>	<u>-40,0</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8837	2,8701	2,8626
(*) Datos preliminares			