

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

	6 Setiembre	7 Setiembre	8 Setiembre	9 Setiembre	10 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8,499.8	10,079.8	11,812.5	13,855.4	16,689.2
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 (CDBCRP)	2 499.9 1 536.5	3 499.9 1 919.6	5 499.9 681.7	6 999.8 108.6	8 999.9 1 500.0 1 999.9 1 400.0
Propuestas recibidas	3 429.4 1 536.5	4 883.0 1 919.6	5 684.2 681.7	7 221.5 108.6	10 872.0 2 551.4 2 680.2 1 649.9
Plazo de vencimiento	1 d. 1 d.	1 d. 1 d.	1 d. 1 d.	1 d. 1 d.	3 d. 32 d. 14 d. 3 d.
Tasas de interés: Mínima	2,40 2,37	2,40 2,26	2,40 2,26	2,37 2,44	2,45 2,99 2,85 2,71
Máxima	2,48 2,48	2,48 2,48	2,48 2,48	2,48 2,48	3,00 3,03 3,00 2,98
Promedio	2,47 2,44	2,47 2,41	2,47 2,44	2,46 2,46	2,94 3,02 2,99 2,93
Saldo	22,621.7	23,019.8	22,141.9	21,068.8	25,375.3
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de setiembre de 2010)					11,624.8
Vencimientos de CD BCRP del 13 al 17 de setiembre de 2010					11,624.8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Saldo					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)					
Saldo					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Saldo					
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Saldo					
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Saldo	84.7	84.7	84.7	84.7	84.7
Próximo vencimiento de Repo (13 de setiembre de 2010)					14.0
Vencimientos de REPO del 13 al 17 de setiembre de 2010					0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	368.7	0.0	0.0	399.3	150.7
i. Compras (millones de US\$)	132.0			143.0	54.0
Tipo de cambio promedio	2.7929			2.7920	2.7900
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
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					
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	4,832.0	4,660.3	5,630.9	7,146.3	2,940.1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0090%	0.0090%	0.0090%	0.0090%	0.0110%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	0.0	310.0
Tasa de interés	1.70%	1.70%	1.70%	1.70%	2.20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4,832.0	4,660.3	5,630.9	7,146.3	2,630.1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8,452.9	7,143.8	7,265.1	7,527.8	7,286.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15.3	12.9	13.1	13.6	13.2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5,969.4	4,660.3	4,781.6	5,044.4	4,802.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10.8	8.4	8.6	9.1	8.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	280.5	145.5	204.5	121.4	149.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,45/2,45/2,45	2,45/2,50/2,45	2,40/2,50/2,44	2,45/2,50/2,49	2,90/2,90/2,90
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	230.2	135.3	37.5	106.9	118.3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,25/1,30/1,25	1,20/1,25/1,24	0,95/1,00/0,97	0,90/1,00/0,97	1,00/1,00/1,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	2065.5	3,527.4	3,623.5	2,639.9	2,803.6
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\$)	3 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre	8 Setiembre	9 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-56.8	-71.3	86.4	31.9	-54.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-110.5	-116.1	28.9	-43.8	-131.4
a. Mercado spot con el público	99.8	56.9	81.3	15.9	58.8
i. Compras	246.5	215.8	230.4	332.4	260.0
ii. (-) Ventas	146.8	158.9	149.1	316.4	201.2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	23.1	8.1	44.3	75.5	179.4
i. Pactadas	44.5	83.6	88.1	188.0	293.4
ii. (-) Vencidas	21.4	75.4	43.8	112.5	113.9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-30.6	-36.7	-13.1	-0.1	102.2
i. Pactadas	63.3	31.3	94.3	127.6	204.6
ii. (-) Vencidas	93.9	68.0	107.4	127.7	102.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	344.0	325.8	367.3	617.6	321.0
ii. A futuro	40.0	50.0	45.0	13.0	110.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	25.3	-46.2	11.0	-46.7	-65.0
i. Compras	31.7	18.8	53.0	65.2	38.9
ii. (-) Ventas	6.4	65.0	42.0	111.9	103.9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-163.1	-134.2	0.2	2.2	-136.8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7937	2.7927	2.7952	2.7939	2.7921
(*) Datos preliminares					

d. = día(s)
Elaboración de la Oficina de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera
m. = mes(es)
a. = año(s)