

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

	3 Enero	4 Enero	5 Enero	6 Enero	7 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	13 970,9	14 858,7	16 697,3	17 946,2	18 109,0
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
Saldo	30,0	30,0	30,0	30,0	30,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (19 de agosto de 2011)					30,0
Vencimientos de CD BCRP del 10 al 14 de enero del 2011					0,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</u>					200,0
Propuestas recibidas					684,0
Plazo de vencimiento					181 d.
Tasas de interés Mínima					0,06
Máxima					0,06
Promedio					0,06
Saldo	3 195,8	3 195,8	3 195,8	3 195,8	3 395,8
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de enero de 2011)					100,0
Vencimientos de CDV BCRP del 10 al 14 de enero del 2011					400,0
iv. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)</u>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (19 de enero de 2011)					100,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 10 al 14 de enero del 2011					0,0
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	890,0	5 896,1	8 297,1	7 762,9	1 000,0
Propuestas recibidas	890,0	5 896,1	8 297,1	7 762,9	2 065,5
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	31 d.
Tasas de interés Mínima	2,95	2,93	2,90	2,95	3,25
Máxima	3,00	3,00	3,00	3,00	3,26
Promedio	3,00	3,00	2,99	3,00	3,25
Saldo	12 268,7	16 593,8	17 694,7	16 160,5	19 397,4
Próximo vencimiento de Depósitos (10 enero del 2011)					10 155,7
Vencimientos de Depósitos del 10 al 14 de enero del 2011					11 625,6
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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>					
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	13 080,9	8 962,6	8 400,2	10 183,3	6 909,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0090%	0,0090%	0,0090%	0,0090%	0,0113%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	4,05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	4,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	5,0
Tasa de interés	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%	2,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	13 080,9	8 962,6	8 400,2	10 183,3	6 904,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 462,2	2 462,2	2 462,2	2 462,2	2 462,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,3	4,2	4,2	4,1	4,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	471,0	474,0	438,0	402,0	628,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,00/3,00	2,95/3,00/3,00	3,00/3,00/3,00	3,00/3,00/3,00	3,25/3,25/3,25
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	44,7	51,6	58,0	53,0	94,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,35/1,20/0,58	0,60/0,80/0,68	0,70/1,25/1,07	1,50/1,90/1,74	2,00/2,25/2,12
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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\$)	31 Diciembre	3 Enero	4 Enero	5 Enero	6 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	41,3	-106,5	46,2	-70,7	86,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	29,7	-73,1	35,1	-122,3	142,3
a. <u> Mercado spot con el público</u>	30,9	-19,9	73,5	-23,4	198,1
i. Compras	80,1	176,6	258,7	188,3	391,9
ii. (-) Ventas	49,2	196,6	185,1	211,7	193,8
b. <u> Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	11,4	-41,4	1,7	-8,7	4,2
i. Pactadas	12,9	-0,2	71,1	91,6	139,5
ii. (-) Vencidas	1,4	41,2	69,3	100,3	135,2
c. <u> Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-0,1	-8,0	-9,4	-60,3	59,8
i. Pactadas	2,1	125,0	104,9	34,6	174,7
ii. (-) Vencidas	2,2	133,0	114,3	94,9	114,9
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	0,0	336,4	458,6	299,4	295,7
ii. A futuro	0,0	50,0	45,0	53,0	88,0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-0,3	58,6	8,3	-60,3	-84,7
i. Compras	0,3	82,8	77,2	37,0	44,1
ii. (-) Ventas	0,6	24,1	68,8	97,3	128,8
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	0,0	-20,0	-1,8	-44,0	8,6
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	--	2,8023	2,8002	2,8023	2,8045
(*) Datos preliminares					

d. = día(s)
s. = semana(s)
m. = mes(es)
a. = año(s)

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera