

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

	31 Enero	1 Febrero	2 Febrero	3 Febrero	4 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8 002,7	8 055,9	8 903,0	9 207,1	9 105,0
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)					
Propuestas recibidas		30,0		30,0	
Plazo de vencimiento		115,0		88,0	
Tasas de interés		191 d.		371 d.	
Mínima		3,6		4,0	
Máxima		3,8		4,3	
Promedio		3,6		4,2	
Saldo	210,0	240,0	240,0	270,0	270,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011)					90,0
Vencimientos de CD BCRP del 3 al 4 de febrero del 2011					0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)			200,0	200,0	100,0
Propuestas recibidas			505,0	400,0	220,0
Plazo de vencimiento			271 d.	272 d.	272 d.
Tasas de interés			0,09	0,10	0,09
Mínima			0,10	0,10	0,10
Máxima			0,09	0,10	0,10
Promedio			0,09	0,10	0,10
Saldo	6 245,7	6 245,7	6 445,7	6 645,7	6 745,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP (16 de mayo de 2011)					3,0
Vencimientos de CDV BCRP del 3 a 4 de febrero del 2011					0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)	30,0	30,0			
Propuestas recibidas	80,0	102,0			
Plazo de vencimiento	59 d.	59 d.			
Tasas de interés	3,39	3,22			
Mínima	3,39	3,22			
Máxima	3,39	3,22			
Promedio	3,39	3,22			
Saldo	1 161,0	1 161,0	1 141,0	1 141,0	991,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (4 de febrero de 2011)					150,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 3 al 4 de febrero del 2011					150,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 801,9			750,7	1 300,0
Propuestas recibidas	4 801,9			750,7	2 018,4
Plazo de vencimiento	1 d.			1 d.	3 d.
Tasas de interés	3,20			3,10	3,13
Mínima	3,25			3,25	3,24
Máxima	3,24			3,22	3,21
Promedio	3,24			3,22	3,21
Saldo	17 858,4	12 956,5	12 011,7	12 762,4	13 311,7
Próximo vencimiento de Depósitos (7 febrero del 2011)					2 300,0
Vencimientos de Depósitos del 3 al 4 de febrero del 2011					7 205,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)		49,8	268,3	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio		18,0	97,0		
ii. Ventas (millones de US\$)		2,7660	2,7660		
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	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					
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	3 200,8	8 075,7	8 971,3	8 226,4	7 705,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0115%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	180,0	0,0	86,4	0,0	24,0
Tasa de interés	2,45%	2,45%	2,45%	2,45%	2,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 020,8	8 075,7	8 884,9	8 226,4	7 681,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 824,4	2 824,4	2 922,0	2 922,0	2 922,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,6	3,1	4,8	4,8	4,8
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. Operaciones a la vista en moneda nacional	694,0	399,5	530,8	460,0	883,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,20/3,25/3,25	3,20/3,25/3,24	3,20/3,30/3,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	58,5	26,0	47,0	72,0	88,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,25/0,25	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50	0,50/2,00/1,18	2,00/2,50/2,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	5,0	0,0	0,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		5,0/3,60			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Enero	31 Enero	1 Febrero	2 Febrero	3 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	133,9	-136,4	-86,1	-45,8	9,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	57,5	-98,3	-45,4	-238,6	-3,0
a. Mercado spot con el público	82,2	-51,5	17,2	-110,0	71,5
i. Compras	322,9	356,8	263,4	188,5	247,3
ii. (-) Ventas	240,7	408,2	246,2	298,5	175,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	69,8	-84,4	-43,5	113,6	-248,9
i. Pactadas	161,0	101,8	148,1	145,7	103,6
ii. (-) Vencidas	91,2	186,2	191,5	32,1	352,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-6,6	-46,3	-2,8	-79,2	-261,8
i. Pactadas	60,3	75,5	97,7	23,5	88,3
ii. (-) Vencidas	66,9	122,2	100,5	102,7	350,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	481,0	356,2	363,5	443,8	465,1
ii. A futuro	34,6	115,0	40,0	230,0	65,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-50,5	-80,2	-116,5	31,9	-77,1
i. Compras	38,1	103,0	66,5	55,0	268,3
ii. (-) Ventas	86,6	183,2	183,0	23,1	345,4
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,5	-30,5	-37,1	-89,9	0,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7755	2,7712	2,7668	2,7658	2,7677
(*) Datos preliminares					

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