

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	22 agosto	23 agosto	24 agosto	25 agosto	26 agosto
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>7 483,6</b>	<b>8 083,3</b>	<b>7 930,8</b>	<b>7 871,4</b>	<b>7 715,3</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)		50,1 200,0	200,0	30,0 200,0	300,1
Propuestas recibidas		251,0 394,3	442,4	152,5 522,4	568,3
Plazo de vencimiento		168 d. 100 d.	99 d	350 d. 98 d.	97 d
Tasas de interés: Mínima		4,25 4,25	4,25	4,30 4,25	4,25
Máxima		4,30 4,28	4,29	4,30 4,28	4,27
Promedio		4,28 4,26	4,27	4,30 4,27	4,26
Saldo	5 250,2	5 500,3	5 700,3	5 930,3	6 230,4
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de setiembre de 2011)	250,0	250,0	250,0	250,0	250,0
Vencimientos de CD BCRP el 26 de agosto del 2011		0,0			0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de Repo el 26 de agosto del 2011					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 309,9	8 309,9	8 309,9	8 309,9	8 309,9
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de octubre de 2011)	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimientos de CDV BCRP el 26 de agosto de 2011		0,0			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 700,0	5 000,0	5 000,0	5 000,0	4 500,0
Propuestas recibidas	5 594,4	5 887,1	5 205,9	5 056,8	4 604,5
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d	1 d	1 d	5 d
Tasas de interés: Mínima	3,98	4,10	4,05	4,06	3,95
Máxima	4,22	4,22	4,24	4,25	4,24
Promedio	4,15	4,17	4,18	4,18	4,15
Saldo	4 700,0	5 000,0	5 000,0	5 000,0	4 500,0
Próximo vencimiento de Depósitos (26 de agosto de 2011)		5 000,0			4 500,0
Vencimientos de Depósitos el 26 de agosto de 2011		5 000,0			4 500,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables					
Vencimientos de CDR BCRP el 26 de agosto de 2011					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	612,1	407,2	136,7	81,1	401,4
i. Compras (millones de US\$)	224,0	149,0	50,0	29,7	147,0
Tipo de cambio promedio	2,7326	2,7329	2,7330	2,7320	2,7305
ii. Ventas (millones de US\$)					
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>3 395,7</b>	<b>3 240,4</b>	<b>2 867,4</b>	<b>2 722,5</b>	<b>3 316,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0128%	0,0128%	0,0129%	0,0129%	0,0136%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>3 395,7</b>	<b>3 240,4</b>	<b>2 858,4</b>	<b>2 722,5</b>	<b>3 307,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 550,6	9 714,3	9 180,9	9 092,3	8 985,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,9	15,2	14,4	14,2	14,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 664,5	6 515,6	6 025,7	5 886,4	5 787,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,9	10,2	9,4	9,2	9,1
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	246,0	232,0	482,0	387,5	433,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,20/4,25/4,24	4,20/4,25/4,20	4,20/4,25/4,20	4,15/4,20/4,20	4,15/4,25/4,20
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	287,8	316,5	174,6	180,7	190,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	538,0	737,9	859,0	675,0	100,0
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>19 Agosto</b>	<b>22 Agosto</b>	<b>23 Agosto</b>	<b>24 Agosto</b>	<b>25 Agosto</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	110,6	-265,5	13,8	16,7	1,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	28,4	-278,7	-29,6	-6,1	-23,9
a. Mercado spot con el público	33,7	-48,8	115,4	35,6	8,0
i. Compras	294,7	162,1	264,0	196,0	203,9
ii. (-) Ventas	260,9	211,0	148,5	160,4	195,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	68,6	20,5	38,7	-53,4	76,6
i. Pactadas	100,9	62,8	111,7	112,1	142,0
ii. (-) Vencidas	32,3	42,3	73,0	165,4	65,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-13,7	7,3	-4,7	-76,1	51,4
i. Pactadas	18,6	33,7	18,9	6,3	78,4
ii. (-) Vencidas	32,2	26,4	23,7	82,4	26,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	491,6	482,0	255,2	433,3	493,4
ii. A futuro	140,0	70,6	90,0	205,0	40,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-8,9	-27,8	-48,5	-82,0	-49,4
i. Compras	21,5	12,4	22,6	79,0	11,2
ii. (-) Ventas	30,4	40,1	71,1	161,0	60,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	3,5	-218,0	-145,9	-42,7	-20,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7348	2,7319	2,7326	2,7322	2,7319
(*) Datos preliminares					