

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	31 Agosto	1 Setiembre	2 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8 041,7	7 656,0	7 856,1
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)		30,0	
Propuestas recibidas		137,3	
Plazo de vencimiento		378 d	
Tasas de interés		4,25	
Máxima		4,27	
Promedio		4,26	
Saldo	6 230,4	6 260,4	6 260,4
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de setiembre de 2011)	250,0		250,0
Vencimientos de CD BCRP al 2 de setiembre del 2011			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 al 2 de setiembre 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
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de octubre de 2011)	200,0		200,0
Vencimientos de CDV BCRP al 2 de setiembre de 2011			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	6 082,2		
Propuestas recibidas	6 082,2		
Plazo de vencimiento	1 d		
Tasas de interés	4,00		
Mínima	4,25		
Máxima	4,18		
Promedio	4,18		
Saldo	6 082,2		
Próximo vencimiento de Depósitos (2 de setiembre de 2011)			0,0
Vencimientos de Depósitos al 2 de setiembre de 2011			0,0
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
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables			0,0
Vencimientos de CDR BCRP al 2 de setiembre de 2011			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	234,5	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	86,0		
Tipo de cambio promedio	2,7268		
ii. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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
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	2 194,0	7 626,0	7 856,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0129%	0,0129%	0,0141%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	18,0	270,0	389,8
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 176,0	7 356,0	7 466,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 181,1	10 554,7	10 609,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,8	16,7	16,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 982,4	7 356,0	7 411,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	11,6	11,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	514,9	543,0	640,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,25/4,19	4,10/4,25/4,25	4,10/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	85,9	99,0	170,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,30/0,20	2,00/2,85/2,51	3,00/3,20/3,12
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	56,5	108,0
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\$)	29 Agosto	31 Agosto	1 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	28,4	-144,8	-110,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	80,7	-37,5	-41,5
a. Mercado spot con el público	79,9	56,3	-21,1
i. Compras	137,9	332,2	218,2
ii. (-) Ventas	58,0	275,9	239,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-57,3	19,8	-46,1
i. Pactadas	3,3	150,3	63,3
ii. (-) Vencidas	60,5	130,5	109,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-4,9	127,0	22,6
i. Pactadas	3,5	202,6	102,9
ii. (-) Vencidas	8,4	75,6	80,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	0,0	309,6	406,8
ii. A futuro	0,0	174,0	140,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-51,3	-72,2	-49,5
i. Compras	5,8	55,9	58,7
ii. (-) Ventas	57,1	128,1	108,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-76,6	0,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés		2,7266	2,7273
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)			
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera