

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	5 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre	8 Setiembre	9 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 981,6	8 157,4	8 251,3	8 413,0	8 759,3
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>	200,0	50,0	200,0	60,0	300,0
Propuestas recibidas	426,0	277,0	688,6	217,5	989,0
Plazo de vencimiento	93 d	189 d	91 d	371 d.	90 d.
Tasas de interés: Mínima	4,21	4,26	4,25	4,25	4,21
Máxima	4,30	4,27	4,27	4,25	4,21
Promedio	4,27	4,27	4,26	4,25	4,21
Saldo	6 460,4	6 510,4	6 710,4	7 070,4	7 370,4
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de setiembre de 2011)	250,0	250,0		250,0	250,0
Vencimientos de CD BCRP del 8 al 9 de setiembre de 2011					0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo				0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo				0,0	0,0
Vencimientos de Repo del 8 al 9 de setiembre de 2011					
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</u>					
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
Vencimientos de CDV BCRP del 8 al 9 de setiembre de 2011					0,0
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	800,0	2 000,0	2 300,0	2 900,0	2 800,1
Propuestas recibidas	2 553,5	2 695,3	2 983,1	3 352,6	2 841,2
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	3,70	3,99	4,12	4,14	3,95
Máxima	4,15	4,25	4,25	4,25	4,25
Promedio	3,99	4,14	4,18	4,21	4,21
Saldo	800,0	2 000,0	2 300,0	2 900,0	2 800,1
Próximo vencimiento de Depósitos (8 de setiembre de 2011)					2 800,1
Vencimientos de Depósitos del 8 al 9 de setiembre de 2011					2 800,1
vi. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)</u>					
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDR BCRP del 8 al 9 de setiembre de 2011	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	0,0	0,0	299,8	531,2	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>			110,0	195,0	
Tipo de cambio promedio			2,7250	2,7240	
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
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>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	6 981,6	6 107,4	6 051,0	5 684,2	5 659,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0129%	0,0129%	0,0129%	0,0129%	0,0129%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	6 981,6	6 107,4	6 051,0	5 684,2	5 659,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 639,6	10 430,2	10 447,9	10 237,9	10 093,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,7	16,3	16,3	16,0	15,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 364,0	7 359,1	7 144,8	6 962,2	6 817,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,5	11,2	11,2	10,9	10,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	299,0	689,1	595,5	498,5	694,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,10/4,20/4,16	4,00/4,20/4,19	4,00/4,25/4,18	4,15/4,25/4,20	4,13/4,25/4,20
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	134,0	171,7	242,0	129,0	203,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/3,20/2,09	1,60/2,50/1,80	1,80/1,85/1,80	1,50/2,00/1,88	2,00/2,05/2,00
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	57,0	200,0	200,0	520,0	646,3
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\$)	2 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre	8 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	147,1	55,3	-15,4	-150,9	-39,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	223,8	28,9	-2,8	-106,6	-64,1
a. <u> Mercado spot con el público</u>	236,6	54,0	22,9	10,7	157,8
i. <u>Compras</u>	413,3	239,0	253,6	196,7	350,7
ii. <u>(-) Ventas</u>	176,7	185,0	230,7	185,9	192,9
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-39,1	14,6	-38,1	57,9	-273,3
i. <u>Pactadas</u>	94,7	25,3	43,3	83,2	15,5
ii. <u>(-) Vencidas</u>	133,8	10,7	81,4	25,3	288,8
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	37,6	-11,9	-25,5	102,1	-297,7
i. <u>Pactadas</u>	68,0	21,6	74,7	170,8	270,2
ii. <u>(-) Vencidas</u>	30,4	33,5	100,2	68,6	567,9
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u>Al contado</u>	254,0	245,4	641,8	480,0	544,0
ii. <u>A futuro</u>	133,0	105,0	5,0	165,0	160,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-115,8	-2,9	4,3	35,5	252,6
i. <u>Compras</u>	16,3	5,6	84,3	55,9	538,3
ii. <u>(-) Ventas</u>	132,1	8,5	80,0	20,4	285,7
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-0,4	0,6	-11,2	-109,5	-195,4
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7302	2,7320	2,7295	2,7250	2,7241
(*) Datos preliminares					