

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

	23 Agosto		24 Agosto		25 Agosto		26 Agosto		27 Agosto																				
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6,997.5		7,241.4		7,049.8		6,173.6		6,151.7																				
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)	2 139.2	200.0	73.0	999.9	2 005.2	700.0	2 500.1	200.0	300.0	1 000.0	1 960.2	2 499.9	200.0	300.0	1 000.1	1 416.4	2 499.8	50.0	101.0	54.0	1 200.0	1 300.2	2 499.9	50.0	200.0	300.0	352.9	1 000.0	500.0
Propuestas recibidas	2 144.2	490.0	673.0	2 137.5	2 005.2	701.0	2 706.9	625.0	963.0	2 032.5	1 960.2	3 138.5	520.0	808.0	1 572.6	1 416.4	2 617.6	160.0	381.0	414.0	1 796.7	1 302.9	2 968.9	130.0	450.0	379.0	427.9	1 708.5	760.5
Plazo de vencimiento	1 d.	88 d.	63 d.	9 d.	1 d.	1 d.	1 d.	87 d.	62 d.	8 d.	1 d.	1 d.	86 d.	61 d.	7 d.	1 d.	1 d.	123 d.	85 d.	60 d.	7 d.	1 d.	4 d.	115 d.	84 d.	59 d.	7 d.	4 d.	4 d.
Tasas de inte Mínima	2.40	3.05	2.80	2.45	2.18	2.37	2.40	3.05	2.88	2.40	2.18	2.40	3.05	2.90	2.38	2.18	2.40	3.30	3.00	2.90	2.45	2.18	2.42	3.29	3.09	2.95	2.45	2.18	2.18
Máxima	2.48	3.05	2.91	2.48	2.48	2.37	2.48	3.05	2.90	2.47	2.48	2.48	3.05	2.90	2.47	2.48	2.48	3.30	3.09	2.95	2.47	2.48	2.50	3.29	3.09	3.02	2.50	2.39	2.40
Promedio	2.46	3.05	2.87	2.48	2.43	2.37	2.46	3.05	2.90	2.47	2.38	2.47	3.05	2.90	2.45	2.40	2.47	3.30	3.09	2.93	2.47	2.41	2.47	3.29	3.09	3.02	2.48	2.29	2.30
Saldo			23,679.8						23,495.7						23,534.7				24,270.4						24,373.2				
Próximo vencimiento de CD BCRP (31 de agosto de 2010)																			4,800.0						3,999.9				
Vencimientos de CD BCRP del 31 de agosto al 3 de setiembre de 2010																			4,800.0						8,552.8				
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																													
Saldo																													
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)																													
Saldo																													
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional																													
Saldo																													
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)																													
Saldo																													
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera																													
Saldo			159.7				159.7						159.7				159.7								159.7				
Próximo vencimiento de Repo (31 de agosto de 2010)																													
Vencimientos de REPO del 31 de agosto al 3 de setiembre de 2010																													
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			195.9				346.9				0.0				269.7				232.2										
i. Compras (millones de US\$)			70.0				124.0				0.0				96.5				83.0										
Tipo de cambio promedio			2.7980				2.7977								2.7952				2.7980										
ii. Ventas (millones de US\$)																													
Tipo de cambio promedio																													
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)																													
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	1,076.1		1,628.0		1,633.4		1,238.3		1,481.2																				
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																													
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)																													
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0090%		0.0090%		0.0090%		0.0090%		0.0094%																				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																													
Tasa de interés	3.30%		3.30%		3.30%		3.30%		3.30%																				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																													
Tasa de interés	3.30%		3.30%		3.30%		3.30%		3.30%																				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0		7.0		450.0		0.0		211.7																				
Tasa de interés	1.70%		1.70%		1.70%		1.70%		1.70%																				
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1,076.1		1,621.0		1,183.4		1,238.3		1,269.5																				
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	4,896.9		4,864.1		4,816.4		4,774.5		4,736.8																				
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9.1		9.0		8.9		8.8		8.7																				
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2,408.7		2,375.9		2,328.2		2,286.3		2,248.6																				
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.5		4.4		4.3		4.2		4.2																				
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																													
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	221.5		194.0		302.4		228.5		429.9																				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,20/2,45/2,44		2,45/2,45/2,45		2,45/2,45/2,46		2,40/2,45/2,45		2,20/2,45/2,43																				
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	247.8		397.5		71.3		30.6		43.5																				
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,95/4,00/4,00		2,75/3,50/2,80		1,90/2,75/2,51		0,25/0,25/0,25		0,30/0,35/0,31																				
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	131.6		143.0		482.4		836.1		396.0																				
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\$)	20 Agosto		23 Agosto		24 Agosto		25 Agosto		26 Agosto																				
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-49.5		-68.5		-86.6		58.3		24.9																				
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-45.9		48.5		-146.3		107.6		-123.3																				
a. Mercado spot con el público	98.0		119.3		31.5		166.1		20.2																				
i. Compras	315.6		260.3		206.8		346.7		222.1																				
ii. (-) Ventas	217.5		141.0		175.3		180.6		201.9																				
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	55.8		-122.1		35.1		-14.6		70.9																				
i. Pactadas	60.0		20.8		167.6		96.2		141.7																				
ii. (-) Vencidas	4.2		143.0		132.6		110.8		70.9																				
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	59.3		-5.2		-24.7		34.6		-77.4																				
i. Pactadas	96.3		87.8		67.4		155.3		52.7																				
ii. (-) Vencidas	36.9		92.9		92.0		120.7		130.1																				
d. Operaciones cambiarias interbancarias																													
i. Al contado	213.4		349.2		292.8		421.5		522.0																				
ii. A futuro	75.0		95.0		140.0		120.0		250.0																				
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	2.1		-51.2		-98.4		-47.6		14.6																				
i. Compras	4.5		57.6		31.6		61.4		78.3																				
ii. (-) Ventas	2.3		108.8		130.0		109.0		63.7																				
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-113.4		-69.6		-120.0		-1.0		-98.9																				
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																													
Tasa de interés																													
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2.7996		2.7990		2.7981		2.7987		2.7951																				
(*) Datos preliminares																													

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