

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	8 Noviembre	9 Noviembre	10 Noviembre	11 Noviembre	12 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 706,9	8 316,6	9 449,9	12 174,3	12 166,8
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
Saldo	2 311,0	2 311,0	2 311,0	2 311,0	2 311,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (18 de noviembre de 2010)					1 141,0
Vencimientos de CD BCRP del 11 al 12 de noviembre de 2010					1 141,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 150,0	1 150,0	1 150,0	1 150,0	1 150,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de enero de 2011)					100,0
Vencimientos de CDV BCRP del 11 al 12 de noviembre de 2010					0,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (19 de enero de 2011)					0,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 11 al 12 de noviembre de 2010					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	100 158,0 900,0	1 518,0 100,0 602,0	800,0 200,0 500,0 1 499,9 59	2 215,0 2 000,0 300,0 105,0 853,4	1 288,0 1 957,1 801,0 440,0 2 698,7
Plazo de vencimiento	210 640,0 3 392,7	3 064,3 380,0 1 224,6	856,6 400,0 750,2 2 746,0 1 091	2 845,0 2 048,7 600,0 105,0 853,4	1 359,4 1 957,1 801,0 598,0 2 698,7
Tasas de interés Mínima	62,4 63,4 1,4	1,4 92,4 30,4	1,4 91,4 30,4	1,4 1,4 99,4 32,4 1,4	1,4 1,4 98,4 31,4 3,4
Máxima	3,17 3,07 2,65	2,60 3,13 3,00	2,63 3,15 3,00	2,60 2,68 3,13 3,00 2,70	2,58 2,60 3,13 3,01 2,99
Promedio	3,17 3,10 2,73	2,70 3,17 3,00	2,87 3,15 3,01	2,70 2,68 3,14 3,05 2,98	3,02 3,00 3,13 3,04 3,00
Saldo	3,17 3,10 2,71	2,67 3,14 3,00	2,71 3,15 3,00	2,92 2,76 3,14 3,01 2,79	3,01 2,97 3,13 3,04 2,96
Próximo vencimiento de Depósitos (11 noviembre de 2010)	20 346,0	21 167,0	22 802,9	20 533,4	21 363,8
Vencimientos de Depósitos del 11 al 12 de noviembre del 2009					7 155,8
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					10 570,8
Saldo	6,0	6,0	6,0	6,0	6,0
Próximo vencimiento de Repo (20 de diciembre de 2010)					0,0
Vencimientos de REPO del 11 al 12 de noviembre de 2010					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Tipo de cambio promedio					
iii. Ventas (millones de US\$)					
iv. Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	6 550,9	6 095,6	4 750,0	6 700,0	5 483,0
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%	0,0078%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. Crédito por reutilización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	268,0	1 148,0	820,0	148,2	0,0
Tasa de interés	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	6 282,9	4 947,6	4 601,8	5 860,9	5 483,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	2 483,5	2 483,5	2 483,5	2 483,5	2 483,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSR) (*)	4,8	4,1	4,1	4,1	4,1
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 TOSR) (*)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 933,5	1 079,5	616,5	567,0	77,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,903,00/2,98	2,753,00/2,88	2,702,50/2,84	2,652,50/2,88	3,003,00/3,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	159,4	72,9	54,7	153,4	319,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,701,80/1,80	1,001,75/1,72	0,801,75/1,07	0,851,00/0,99	1,001,50/1,37
c. Total mercado secundario de CD BCRP y CD BCRP-NR	590,0	530,0	250,0	0,0	0,0
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\$)	5 Noviembre	8 Noviembre	9 Noviembre	10 Noviembre	11 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f	71,5	-14,3	117,9	-17,3	-237,3
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f	-31,3	-32,6	-34,7	-140,8	49,7
a. Mercado spot con el público	40,9	38,7	16,0	6,5	85,1
i. Compras	240,4	225,1	248,1	267,5	268,9
ii. (-) Ventas	199,6	186,4	232,1	261,0	203,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	204,4	18,7	172,1	-67,6	50,3
i. Prácticas	242,9	124,9	258,0	211,1	73,0
ii. (-) Vencidas	38,5	106,2	125,9	288,7	22,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	161,7	8,4	161,5	-61,1	337,2
i. Prácticas	120,8	58,9	93,3	112,3	384,6
ii. (-) Vencidas	19,1	58,5	73,8	203,4	47,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	560,9	565,3	736,7	560,5	485,6
ii. A futuro	65,0	5,0	30,0	162,0	37,6
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-28,3	-103,8	-99,8	-224,3	-17,2
i. Compras	5,1	1,2	24,0	71,1	2,8
ii. (-) Ventas	31,3	105,0	123,8	295,4	20,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-65,2	-15,1	-3,0	-18,3	6,5
a. Crédito por reutilización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,7829	2,7958	2,7978	2,8008	2,7994
(*) Datos preliminares					
d. = data(s)					
s. = semestral					
m. = mes(es)					
a. = año(s)					