

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

	7 Febrero	8 Febrero	9 Febrero	10 Febrero	11 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	10 279,4	10 816,1	11 470,3	13 764,0	15 746,2
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>					
Propuestas recibidas		30,0		30,0	
Plazo de vencimiento		113,0		127,0	
Tasas de interés: Mínima		184 d.		364 d.	
Máxima		3,6		4,2	
Promedio		3,7		4,3	
Saldo	270,0	300,0	300,0	330,0	330,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011)					90,0
Vencimientos de CD BCRP del 14 al 18 de febrero del 2011					0,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</u>	200,0	200,0	200,0		200,0
Propuestas recibidas	405,0	500,0	419,0		440,5
Plazo de vencimiento	270 d.	272 d.	272 d.		271 d.
Tasas de interés: Mínima	0,10	0,10	0,09		0,09
Máxima	0,10	0,10	0,10		0,09
Promedio	0,10	0,10	0,10		0,09
Saldo	6 945,7	7 145,7	7 345,7	7 345,7	7 545,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP (16 de mayo de 2011)					3,0
Vencimientos de CDV BCRP del 14 al 18 de febrero del 2011					0,0
iv. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)</u>	150,0				
Propuestas recibidas	345,0				
Plazo de vencimiento	60 d.				
Tasas de interés: Mínima	3,31				
Máxima	3,31				
Promedio	3,31				
Saldo	991,0	991,0	991,0	991,0	991,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (21 de marzo de 2011)					100,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 14 al 18 de febrero del 2011					0,0
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	3 099,9	3 756,0	3 173,0	3 629,9	424,5
Propuestas recibidas	3 470,9	3 757,0	3 178,0	3 629,9	1 526,5
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	28 d.
Tasas de interés: Mínima	3,19	3,19	3,19	3,20	3,51
Máxima	3,25	3,25	3,25	3,25	3,55
Promedio	3,23	3,23	3,23	3,24	3,53
Saldo	14 111,6	14 367,7	13 184,7	10 757,6	17 231,4
Próximo vencimiento de Depósitos (14 febrero del 2011)					11 321,8
Vencimientos de Depósitos del 14 al 18 de febrero del 2011					12 221,8
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	439,8			257,2	359,6
i. Compras (millones de US\$)	159,0			93,0	130,0
Tipo de cambio promedio	2,7660			2,7660	2,7658
ii. Ventas (millones de US\$)					
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. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>					
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	7 419,3	6 830,1	8 097,3	10 361,3	4 781,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0115%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,30%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	4,05%	4,05%	4,05%	4,05%	4,30%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	2,45%	2,45%	2,45%	2,45%	2,70%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	7 419,3	6 830,1	8 097,3	10 361,3	4 781,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 922,0	2 922,0	2 922,0	2 922,0	2 922,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,8	4,8	4,8	4,8	4,8
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 TOSE) (*)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	418,0	420,0	547,8	512,8	572,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,25/3,25/3,25	3,25/3,25/3,25	3,20/3,25/3,25	3,20/3,30/3,25	3,45/3,50/3,47
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	109,0	207,5	216,0	194,0	202,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,00/2,15/2,02	2,00/2,05/2,01	2,00/2,05/2,01	2,00/2,05/2,01	2,00/2,05/2,00
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	1,9	0,0	7,0	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\$)	4 Febrero	7 Febrero	8 Febrero	9 Febrero	10 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	59,4	-121,8	10,8	72,1	-88,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	103,2	-73,9	190,5	98,8	-20,1
a. <u>Mercado spot con el público</u>	84,0	221,4	186,3	145,2	86,4
i. Compras	286,3	420,6	331,0	351,1	306,1
ii. (-) Ventas	202,3	199,2	144,7	203,0	219,7
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	7,3	-115,7	-86,8	32,5	-45,7
i. Pactadas	117,0	34,0	52,2	156,8	245,1
ii. (-) Vencidas	109,8	149,7	139,0	124,3	290,8
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	51,1	-67,7	92,9	59,2	22,3
i. Pactadas	109,1	109,4	155,7	110,0	127,4
ii. (-) Vencidas	57,9	177,2	62,8	50,8	105,1
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	278,2	482,6	465,4	442,2	500,0
ii. A futuro	85,0	135,0	30,0	155,0	50,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-90,1	-108,9	-76,0	-117,8	-192,1
i. Compras	10,7	36,3	60,0	1,2	93,0
ii. (-) Ventas	100,7	145,2	136,0	119,0	285,1
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	57,5	-158,9	4,0	-2,1	-100,1
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7669	2,7662	2,7677	2,7676	2,7667
(*) Datos preliminares					

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