

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

	09 mayo	10 mayo	11 mayo	12 mayo	13 mayo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	6 846,2	6 960,7	6 632,4	6 538,8	6 258,8
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)					
Propuestas recibidas		50,0		30,0	
Plazo de vencimiento		140,4		92,0	
Tasas de interés: Mínima		189 d.		1 a.	
Máxima		4,80		5,10	
Promedio		4,90		5,20	
Saldo	1 359,9	1 409,9	1 409,9	1 439,9	1 439,9
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de julio de 2011)					190,0
Vencimientos de CD BCRP del 16 al 20 mayo del 2011					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)		2 500,0	1 600,0	3 150,0	
Propuestas recibidas		2 500,0	1 600,0	3 150,0	
Plazo de vencimiento		1 d.	1 d.	1 d.	
Tasas de interés: Mínima		4,80	4,80	4,80	
Máxima		4,80	4,80	4,80	
Promedio		4,80	4,80	4,80	
Saldo		2 500,0	1 600,0	3 150,0	
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimientos de Repo del 16 al 20 mayo 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	10 855,7	10 855,7	10 855,7	10 855,7	10 855,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP (16 de mayo de 2011)					3,0
Vencimientos de CDV BCRP del 16 al 20 mayo del 2011					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					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimientos de CDLD BCRP del 16 al 20 mayo del 2011					
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	430,0	430,0			
Próximo vencimiento de Depósitos					
Vencimientos de Depósitos del 16 al 20 mayo del 2011					
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0	1 800,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (28 de junio del 2011)					300,0
Vencimientos de Certificados de Depósitos Reajustables del 16 al 20 mayo del 2011					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0		0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
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	6 846,2	9 410,7	8 232,4	9 658,8	6 258,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0126%	0,0127%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,80%	4,80%	4,80%	4,80%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	33,0	36,0	36,0	48,0	51,0
	3,20%	3,20%	3,20%	3,20%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	6 813,2	9 374,7	8 196,4	9 610,8	6 207,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 167,0	9 040,2	8 485,3	8 485,3	8 485,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,3	14,7	13,8	13,8	13,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 231,8	6 104,2	5 549,3	5 549,3	5 549,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,5	9,9	9,0	9,0	9,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	435,5	327,5	380,5	238,0	1 071,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,00/4,00	4,00/4,00/4,00	4,00/4,50/4,07	4,00/4,00/4,00	4,25/4,55/4,43
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	104,3	275,0	252,5	228,7	253,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,30/0,26	0,25/0,45/0,38	0,40/0,50/0,49	0,45/0,50/0,50	0,45/0,50/0,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	383,5	564,7	431,0	210,5	515,0
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\$)	06 Mayo	09 Mayo	10 Mayo	11 Mayo	12 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-193,1	-5,8	-22,5	8,8	-30,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	9,8	2,9	58,2	-28,3	-65,1
a. Mercado spot con el público	15,9	7,1	51,5	-22,7	39,6
i. Compras	387,2	215,3	320,4	340,1	329,7
ii. (-) Ventas	371,3	208,2	269,0	362,8	290,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-1,7	-39,6	-76,1	37,6	-15,9
i. Pactadas	56,0	60,4	-9,0	54,5	20,6
ii. (-) Vencidas	57,7	99,9	67,1	16,9	36,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	201,2	-30,9	4,6	0,5	-50,4
i. Pactadas	212,6	122,7	100,3	68,4	101,8
ii. (-) Vencidas	11,5	153,6	95,7	67,9	152,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	893,2	666,2	364,3	517,5	520,0
ii. A futuro	260,0	93,0	10,0	66,5	30,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-45,5	49,2	35,4	43,7	11,0
i. Compras	10,2	144,9	95,4	55,8	42,8
ii. (-) Ventas	55,8	95,7	60,0	12,1	31,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6,8	0,2	0,0	1,6	0,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7960	2,7919	2,7915	2,7940	2,7813
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

d. = día(s)

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