

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	10 Octubre	11 Octubre	12 Octubre	13 Octubre	14 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 771,5	5 168,9	5 271,7	5 293,5	4 992,7
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)		50,0		30,0	
Propuestas recibidas		336,0		170,0	
Plazo de vencimiento		182 d		364 d	
Tasas de interés: Mínima		4,17		4,16	
Máxima		4,18		4,17	
Promedio		4,18		4,17	
Saldo	8 180,3	7 030,3	7 030,3	7 060,3	7 060,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de noviembre de 2011)		1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Vencimientos de CD BCRP del 17 al 21 de octubre de 2011					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	4 750,0	3 000,0	2 000,0	410,0	
Propuestas recibidas	6 185,0	3 100,0	2 138,0	510,0	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de interés: Mínima	4,25	4,25	4,25	4,25	
Máxima	4,38	4,35	4,32	4,28	
Promedio	4,30	4,25	4,25	4,26	
Saldo	4 750,0	3 000,0	2 000,0	410,0	
Próximo vencimiento de Repo (17 de octubre de 2011)					
Vencimientos de Repo del 17 al 21 de octubre de 2011					
iii. Subasta de Certificados de Depósito--					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 309,9	8 109,9	7 910,0	7 710,0	7 510,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (17 de octubre de 2011)				200,0	200,0
Vencimientos de CDV BCRP del 17 al 21 de octubre de 2011					1 500,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
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 Depósitos (17 de octubre de 2011)					
Vencimientos de Depósitos del 17 al 21 de octubre de 2011			0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	590,0	590,0	590,0	590,0	590,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (22 de noviembre de 2011)	490,0	490,0	490,0	490,0	490,0
Vencimientos de CDR BCRP del 17 al 21 de octubre de 2011					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	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\$)	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. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	8 521,5	8 118,9	7 271,7	5 673,5	4 992,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0129%	0,0129%	0,0129%	0,0129%	0,0141%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	66,0	70,0	76,0	73,0	73,0
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	8 455,5	8 048,9	7 195,7	5 596,5	4 919,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 121,9	12 154,4	10 347,5	10 291,1	10 241,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,6	15,9	16,0	15,9	15,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	9 161,2	7 258,4	7 330,1	7 318,9	7 147,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,8	11,8	11,2	11,1	11,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	467,8	520,0	609,5	970,0	771,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,30/4,30/4,30	4,30/4,30/4,30	4,25/4,30/4,29	4,15/4,35/4,25	4,20/4,25/4,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	266,5	326,0	227,3	299,6	236,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40/0,50/0,50	0,50/0,55/0,50	0,50/0,55/0,50	0,50/0,60/0,57	0,50/0,80/0,60
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	442,0	388,1	143,2	0,0	3,1
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\$)	07 Octubre	10 Octubre	11 Octubre	12 Octubre	13 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	142,3	-214,2	-23,2	44,4	121,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	82,4	-124,1	-31,4	-58,9	93,0
a. Mercado spot con el público	93,5	-118,7	-26,3	-59,6	85,0
i. Compras	312,5	105,4	184,5	245,4	353,5
ii. (-) Ventas	219,0	224,1	210,8	305,0	268,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	18,0	-93,2	-10,2	103,5	-112,5
i. Pactadas	38,6	36,8	80,9	190,1	24,1
ii. (-) Vencidas	20,6	130,0	91,1	86,6	136,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-41,9	-3,1	-18,4	0,2	-140,6
i. Pactadas	16,0	15,5	132,0	210,6	200,0
ii. (-) Vencidas	57,9	18,6	150,4	210,4	340,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	500,1	260,1	832,7	607,1	762,3
ii. A futuro	114,0	65,0	40,0	47,0	125,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	30,3	-108,7	54,4	120,4	211,9
i. Compras	40,2	5,4	139,7	203,4	339,7
ii. (-) Ventas	9,8	114,0	85,3	82,9	127,9
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,1	-8,2	-0,2	4,1	0,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7420	2,7285	2,7295	2,7256	2,7266
(*) Datos preliminares					