

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	17 Octubre	18 Octubre	19 Octubre	20 Octubre	21 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 314,5	5 403,4	5 222,0	5 639,4	5 514,7
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)					
Propuestas recibidas		100,0		60,0	
Plazo de vencimiento		552,0		325,3	
Tasas de interés: Mínima		175 d		357 d	
Máxima		4,15		4,15	
Promedio		4,17		4,15	
Saldo	7 060,3	7 160,3	7 160,3	7 220,3	7 220,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de noviembre de 2011)	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 21 de octubre del 2011					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)		500,0	640,0		
Propuestas recibidas		820,0	640,0		
Plazo de vencimiento		1 d	1 d		
Tasas de interés: Mínima		4,25	4,25		
Máxima		4,30	4,26		
Promedio		4,26	4,25		
Saldo		500,0	640,0		
Próximo vencimiento de Repo (20 de octubre de 2011)					
Vencimientos de Repo del 20 al 21 de octubre 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	7 310,0	7 010,0	6 610,0	6 210,0	6 010,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (20 de octubre de 2011)	300,0	400,0	400,0		200,0
Vencimientos de CDV BCRP del 20 al 21 de octubre de 2011					1 400,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 20 al 21 de octubre de 2011					0,0
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 (20 de octubre de 2011)					
Vencimientos de Depósitos del 20 al 21 de octubre de 2011					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 20 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	5 314,5	5 803,4	5 862,0	5 579,4	5 514,7
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	168,0	0,0	81,0	288,0	487,0
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	5 146,5	5 803,4	5 781,0	5 291,4	5 027,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 765,4	10 051,0	8 875,4	9 645,5	9 594,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,0	15,5	13,7	14,9	14,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 024,5	6 665,3	6 617,4	6 573,4	6 499,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,3	10,7	8,9	10,1	10,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	892,0	1 321,5	1 003,5	1 027,0	708,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,26	4,25/4,30/4,30	4,25/4,30/4,30	4,25/4,30/4,27	4,15/4,25/4,23
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	170,0	6,0	39,9	43,9	1,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40/0,40/0,40	0,50/0,55/0,53	0,20/0,50/0,23	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,0	9,0	0,0	353,6	342,6
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\$)	14 Octubre	17 Octubre	18 Octubre	19 Octubre	20 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-7,6	135,9	-32,2	47,6	-56,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	75,1	-5,7	-15,2	34,5	-34,6
a. Mercado spot con el público	141,3	2,3	17,4	54,1	3,6
i. Compras	358,6	277,3	224,4	331,6	300,4
ii. (-) Ventas	217,4	275,0	207,0	277,5	296,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-8,7	118,8	98,2	2,5	-36,6
i. Pactadas	95,8	133,8	137,7	158,5	178,2
ii. (-) Vencidas	104,6	15,0	39,5	156,0	214,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	74,0	-22,8	115,3	-10,6	-15,1
i. Pactadas	151,0	89,1	167,0	173,4	323,7
ii. (-) Vencidas	77,0	111,9	51,7	184,0	338,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	375,9	299,6	335,1	1099,2	816,1
ii. A futuro	51,0	40,0	25,0	33,0	138,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-35,1	90,1	10,2	28,9	125,9
i. Compras	65,5	99,2	49,1	183,8	338,0
ii. (-) Ventas	100,6	9,1	38,8	154,9	212,1
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-58,6	-1,2	-30,5	-20,4	-40,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7191	2,7223	2,7225	2,7216	2,7260
(*) Datos preliminares					