

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	24 Octubre	25 Octubre	26 Octubre	27 Octubre	28 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 470,1	5 476,2	5 534,7	5 709,0	5 933,9
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	200,0	100,0	300,0	60,0	
Plazo de vencimiento	958,8	692,0	750,5	317,2	
Tasas de interés: Mínima	81 d	168 d	80 d	79 d	350 d
Máxima	4,10	4,10	4,10	4,10	4,10
Promedio	4,15	4,14	4,15	4,13	4,13
Saldo	4,15	4,12	4,13	4,12	4,11
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de noviembre de 2011)	7 420,3	7 820,3	8 120,3	8 180,3	8 180,3
Vencimientos de CD BCRP del 27 al 28 de octubre del 2011	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0	1 100,0
	0,0				0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo (27 de octubre de 2011)					
Vencimientos de Repo del 27 al 28 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					
Próximo vencimiento de CDV BCRP (27 de octubre de 2011)	5 810,0	5 510,0	5 210,0	4 910,0	4 610,0
Vencimientos de CDV BCRP del 27 al 28 de octubre de 2011	300,0	300,0			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					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 27 al 28 de octubre de 2011	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 200,0	1 100,0	1 800,0	1 700,0	1 700,0
Plazo de vencimiento	1 498,7	1 872,5	2 600,0	2 000,1	1 844,1
Tasas de interés: Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	5 d
Máxima	4,00	4,10	4,14	4,09	3,95
Promedio	4,20	4,19	4,17	4,15	4,15
Saldo	4,12	4,17	4,16	4,11	4,11
Próximo vencimiento de Depósitos (27 de octubre de 2011)	1 200,0	1 100,0	1 800,0	1 700,0	1 700,0
Vencimientos de Depósitos del 27 al 28 de octubre de 2011					1 700,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (22 de noviembre de 2011)	590,0	590,0	590,0	590,0	590,0
Vencimientos de CDR BCRP del 27 al 28 de octubre de 2011	490,0	490,0	490,0	490,0	490,0
					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	29,8	270,6
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio				11,0	100,0
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	-25,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	25,0
ii. Compras de BTP					0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 070,1	3 976,2	3 434,7	3 978,7	4 504,6
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%	0,0137%
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					
Tasa de interés	23,0	66,0	81,0	50,0	315,5
	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	4 047,1	3 910,2	3 353,7	3 928,7	4 189,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 377,6	7 004,6	9 206,5	9 142,7	9 052,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,5	10,8	14,2	14,2	14,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 283,2	6 222,5	6 129,9	6 023,2	5 957,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,7	6,0	9,5	9,4	9,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	917,5	1 371,0	1 299,0	1 296,3	707,3
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,10/4,25/4,21	4,25/4,40/4,26	4,25/4,30/4,26	4,25/4,30/4,27	4,25/4,30/4,27
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	52,0	46,7	137,2	157,0	230,3
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	8,5	18,6	3,7	307,0	365,0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Octubre	24 Octubre	25 Octubre	26 Octubre	27 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-33,4	-100,9	-23,2	12,6	-14,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	65,7	-15,1	-140,9	39,4	-91,9
a. Mercado spot con el público	63,3	-1,8	-151,5	89,6	-102,7
i. Compras	386,9	268,5	251,3	359,1	312,0
ii. (-) Ventas	323,5	270,3	402,9	269,5	414,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	22,6	-23,6	61,2	1,1	46,3
i. Pactadas	60,5	102,0	227,9	70,4	245,8
ii. (-) Vencidas	37,9	125,7	166,7	69,3	199,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	121,7	62,2	-56,5	27,8	-31,2
i. Pactadas	216,1	239,8	144,8	115,5	161,4
ii. (-) Vencidas	94,4	177,6	201,4	87,7	192,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	436,2	430,0	434,5	434,5	672,9
ii. A futuro	84,0	75,0	175,0	15,0	91,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	59,1	46,7	46,4	10,3	18,5
i. Compras	93,9	162,9	200,9	46,0	192,5
ii. (-) Ventas	34,8	116,1	154,5	35,7	174,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,3	-8,1	-1,1	-42,1	-14,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7200	2,7176	2,7164	2,7192	2,7084
(*) Datos preliminares					