

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

	31 Agosto	1 Setiembre	2 Setiembre	3 Setiembre	4 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 584,3	1 705,4	1 824,3	1 844,9	2 025,6
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	1 150,1	400,0	550,0	600,0	600,0
Plazo de vencimiento	1 206,1	750,5	895,2	770,0	824,9
Tasas de interés: Mínima	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	3 d.
Máxima	1,01	1,01	1,01	1,01	0,93
Promedio	1,20	1,20	1,12	1,01	1,01
Saldo	1,11	1,04	1,03	1,01	0,99
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de setiembre del 2009)	9 406,7	8 656,6	8 806,6	8 856,6	8 856,6
Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de setiembre del 2009					1 400,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					1 400,0
Saldo	109,1	109,1	109,1	109,1	109,1
Próximo vencimiento de Repo (20 de noviembre del 2009)					109,1
Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de setiembre del 2009					0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)					
Saldo	655,0	655,0	655,0	655,0	655,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (21 de setiembre del 2009)					200,0
Vencimientos de CDR BCRP del 7 al 11 de setiembre del 2009					0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Saldo	--	--	--	--	--
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Saldo	330,5	330,5	330,5	330,5	330,5
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (25 de setiembre del 2009)					100,0
Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de setiembre del 2009					0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					25,0
Propuestas recibidas					155,0
Plazo de vencimiento					1 a.
Tasas de interés: Mínima					1,35
Máxima					2,00
Promedio					1,67
Saldo	189,8	189,8	189,8	189,8	214,8
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)					39,8
Vencimientos de Repo del 7 al 11 de setiembre del 2009					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\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	434,2	1 305,4	1 274,3	1 244,9	1 449,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0052%	0,0051%	0,0051%	0,0051%	0,0052%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	159,2	0	14,0	46,0	0,0
Tasa de interés	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%	0,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	275,0	1 305,4	1 260,3	1 198,9	1 449,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 835,2	3 491,7	3 469,2	3 479,1	3 526,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,5	6,7	7,8	8,1	8,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	648,9	1 305,4	1 282,9	1 254,9	1 303,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,5	2,5	2,9	2,9	3,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1.10/1.25/1.21	1,20/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,30/1,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	15,0	119,0	87,0	85,0	112,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,22/0,22/0,22	0,22/0,22/0,22	0,22/0,22/0,22	0,22/0,22/0,22	0,22/0,30/0,22
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	0,4	0,0	0,0	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\$)	28 Agosto	31 Agosto	1 Setiembre	2 Setiembre	3 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	87,3	17,1	32,8	-26,9	4,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-77,2	-95,1	-39,6	-145,2	0,1
a. Mercado spot con el público	-82,3	-43,1	-35,7	-126,0	-0,5
i. Compras	136,5	161,0	89,5	82,8	95,4
ii. (-) Ventas	218,9	204,1	125,2	208,8	95,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	333,5	72,7	148,4	87,4	-188,7
i. Pactadas	337,8	185,3	283,4	144,6	87,4
ii. (-) Vencidas	4,3	112,5	135,0	57,2	276,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	169,0	-39,5	76,0	-30,9	-193,0
i. Pactadas	197,7	127,2	299,1	126,9	96,7
ii. (-) Vencidas	28,8	166,7	223,2	157,8	289,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	399,3	533,6	657,3	429,6	486,2
ii. A futuro	25,0	10,0	71,0	0,0	59,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	25,6	56,2	88,8	87,5	14,2
i. Compras	28,2	162,6	222,8	143,4	288,9
ii. (-) Ventas	2,6	106,4	134,0	55,9	274,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,0	-54,1	-4,5	-6,0	0,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9384	2,9483	2,9528	2,9487	2,9439
(*) Datos preliminares					