

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

	7 Setiembre	8 Setiembre	9 Setiembre	10 Setiembre	11 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 983,0	2 588,0	1 878,6	1 417,2	1 674,1
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)	400,0	1 114,1	400,0	1 100,0	1 100,0
Propuestas recibidas	1 313,0	1 114,1	1 424,5	1 846,0	1 215,9
Plazo de vencimiento	3 m.	1 d.	1 m.	1 d.	3 d.
Tasas de interés: Mínima	1,16	0,94	1,03	0,80	0,94
Máxima	1,25	1,23	1,22	1,09	1,16
Promedio	1,24	1,03	1,18	1,04	1,06
Saldo	8 970,7	9 356,6	9 556,5	9 756,6	9 756,6
Próximo vencimiento de CD BCRP (14 de setiembre del 2009)					1 100,0
Vencimientos de CD BCRP del 14 al 18 de setiembre del 2009					1 100,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
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 14 al 18 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 14 al 18 de setiembre del 2009					0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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 14 al 18 de setiembre del 2009					0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Propuestas recibidas					14,0
Plazo de vencimiento					94,0
Tasas de interés: Mínima					1,37
Máxima					1,73
Promedio					1,58
Saldo	214,8	214,8	214,8	214,8	228,8
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)					39,8
Vencimientos de Repo del 14 al 18 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 operación	1 468,9	1 088,0	578,7	317,2	585,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0052%	0,0052%	0,0052%	0,0052%	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					
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 a cierre de operaciones	1 429,4	874,5	408,7	250,7	564,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 586,2	3 525,1	3 425,9	3 335,5	3 285,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,4	8,2	8,0	7,8	7,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 363,3	1 302,2	1 202,9	1 112,5	1 062,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,2	3,0	2,8	2,6	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	905,5	338,5	277,0	409,7	497,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,15/1,25/1,25	1,15/1,25/1,25	1,05/1,20/1,07	1,00/1,10/1,06	0,90/1,15/1,14
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	130,5	18,6	57,0	10,0	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	0,20/0,22/0,22
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	0,0	1,0	3,0	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\$)	4 Setiembre	7 Setiembre	8 Setiembre	9 Setiembre	10 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	21,1	-43,3	15,4	9,9	11,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-11,4	-9,8	1,9	36,7	-44,3
a. Mercado spot con el público	10,9	-15,7	0,3	11,3	-47,9
i. Compras	137,8	110,7	125,8	236,5	128,1
ii. (-) Ventas	126,9	126,4	125,5	225,3	176,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	26,6	-2,2	-41,6	67,5	-10,3
i. Pactadas	41,9	31,1	90,6	191,6	175,3
ii. (-) Vencidas	15,3	33,4	132,1	124,1	185,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	2,2	31,3	-55,0	94,2	-66,5
i. Pactadas	95,8	63,5	111,8	235,4	122,7
ii. (-) Vencidas	93,6	32,2	166,8	141,1	189,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	361,2	199,3	276,3	443,4	436,0
ii. A futuro	43,0	23,0	26,0	12,0	61,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega:	75,2	1,8	35,6	18,4	5,1
i. Compras	85,9	32,0	166,6	140,9	188,9
ii. (-) Ventas	10,8	30,2	131,0	122,5	183,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras:	-11,0	3,0	0,7	24,0	2,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9341	2,9305	2,9188	2,9214	2,9270
(*) Datos preliminares					