

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

| | 28 Setiembre | 29 Setiembre | 30 Setiembre | 1 Octubre | 2 Octubre |
|--|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 2 610,2 | 2 283,9 | 2 234,8 | 1 567,7 | 1 756,7 |
| 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) | 500,0 | 2 000,0 | 500,0 | 1 750,1 | 400,0 |
| Propuestas recibidas | 1 066,0 | 2 070,6 | 893,0 | 2 018,8 | 679,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 m. 1 d. | 1 m. 1 d. |
| Tasas de interés: Mínima | 1,23 | 1,12 | 1,23 | 1,12 | 1,24 |
| Máxima | 1,25 | 1,23 | 1,25 | 1,20 | 1,27 |
| Promedio | 1,24 | 1,16 | 1,25 | 1,18 | 1,26 |
| Saldo | 11 756,6 | 12 006,7 | 11 999,3 | 10 656,6 | 11 156,6 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (5 de octubre del 2009) | | | | | 500,0 |
| Vencimientos de CD BCRP del 5 al 7 de octubre del 2009 | | | | | 500,0 |
| 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 5 al 7 de octubre del 2009 | | | | | 0,0 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP) | | | | | |
| Saldo | 105,0 | 105,0 | 105,0 | 105,0 | 60,0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP (7 de octubre del 2009) | | | | | 60,0 |
| Vencimientos de CDR BCRP del 5 al 7 de octubre del 2009 | | | | | 60,0 |
| 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 | 230,5 | 230,5 | 230,5 | 230,5 | 230,5 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (20 de noviembre del 2009) | | | | | 230,5 |
| Vencimientos de CD BCRP del 5 al 7 de octubre del 2009 | | | | | 0,0 |
| vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 271,8 | 271,8 | 271,8 | 271,8 | 271,8 |
| Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010) | | | | | 39,8 |
| Vencimientos de Repo del 5 al 7 de octubre 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\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 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 | 242,2 | 153,5 | 603,1 | 1 567,7 | 1 309,7 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0053% | 0,0052% | 0,0053% | 0,0052% | 0,0053% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 2,05% | 2,05% | 130,0 | 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 | 74,9 | 26,7 | 69,4 | 193,8 | 101,8 |
| | 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 | 167,3 | 126,8 | 403,7 | 1 373,9 | 1 207,9 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 2 801,7 | 2 786,1 | 2 780,8 | 3 596,9 | 3 513,9 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,5 | 6,5 | 6,5 | 8,8 | 8,4 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 578,7 | 563,1 | 557,8 | 1 373,9 | 1 290,9 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1,4 | 1,3 | 1,3 | 3,4 | 3,1 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 178,0 | 352,5 | 422,5 | 661,0 | 399,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,15/1,15/1,15 | 1,10/1,25/1,15 | 1,15/1,25/1,24 | 1,10/1,25/1,22 | 1,00/1,15/1,12 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 77,0 | 35,0 | 20,0 | 73,0 | 54,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,21/0,21/0,21 | 0,21/0,21/0,21 | 0,21/0,21/0,21 | 0,21/0,21/0,21 | 0,21/0,21/0,21 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR | 85,0 | 0,0 | 2,0 | 65,0 | 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\$) | 25 Setiembre | 28 Setiembre | 29 Setiembre | 30 Setiembre | 1 Octubre |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | -21,5 | -91,8 | 14,4 | 90,5 | -4,0 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | -120,2 | -81,1 | -82,0 | 20,6 | 27,4 |
| a. Mercado spot con el público | -76,8 | -28,4 | -77,4 | 25,5 | 19,1 |
| i. Compras | 151,1 | 133,4 | 152,0 | 205,0 | 175,2 |
| ii. (-) Ventas | 227,9 | 161,8 | 229,5 | 179,5 | 156,1 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 95,6 | 50,8 | 156,1 | 159,0 | -208,3 |
| i. Pactadas | 128,0 | 181,2 | 253,8 | 303,3 | 80,0 |
| ii. (-) Vencidas | 32,4 | 130,4 | 97,8 | 144,3 | 288,3 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -3,1 | 61,4 | 59,6 | 89,2 | -176,9 |
| i. Pactadas | 85,8 | 138,4 | 124,5 | 192,7 | 49,7 |
| ii. (-) Vencidas | 89,0 | 77,0 | 64,9 | 103,5 | 226,6 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 257,0 | 232,5 | 237,5 | 265,1 | 302,0 |
| ii. A futuro | 70,0 | 56,0 | 45,0 | 48,0 | 83,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 63,6 | -50,4 | -32,4 | -38,7 | -62,4 |
| i. Compras | 83,7 | 76,0 | 64,9 | 103,1 | 225,0 |
| ii. (-) Ventas | 20,1 | 126,4 | 97,4 | 141,7 | 287,3 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -50,4 | -55,8 | -5,0 | -7,0 | 9,0 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,8807 | 2,8829 | 2,8898 | 2,8831 | 2,8904 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |