

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

	9 Agosto				10 Agosto				11 Agosto				12 Agosto			13 Agosto			
	10 046,4				5 225,0				5 608,5				4 127,2			4 898,4			
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR																			
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	1 128,0	2 786,0	2 383,0	5 342,7	224,0	2 412,6	1 508,6	3 781,4	3,0	425,0	917,1	3 048,7	1 39	529,0	606,0	1 448,4	1 573,1	1 477,8	1 013,5
Plazo de vencimiento	63 d.	31 d.	14 d.	1 d.	62 d.	31 d.	14 d.	1 d.	1 d.	33 d.	14 d.	1 d.	1	32 d.	14 d.	1 d.	3 d.	7 d.	3 d.
Tasas de inte Mínima	2,55	2,42	2,20	1,93	2,60	2,47	2,40	2,29	59	2,47	2,43	2,29	2,1	2,40	2,44	2,07	2,12	2,35	2,10
Máxima	2,63	2,50	2,44	2,44	2,61	2,48	2,44	2,40	59	2,55	2,52	2,29	2,1	2,55	2,52	2,22	2,49	2,48	2,49
Promedio	2,61	2,48	2,39	2,37	2,61	2,48	2,44	2,36	59	2,51	2,46	2,29	2,1	2,52	2,49	2,15	2,35	2,42	2,23
Saldo	20 788,5				21 938,7				22 630,6				22 783,6			23 010,4			
Próximo vencimiento de CD BCRP (16 de agosto de 2010)																3 626,6			
Vencimientos de CD BCRP del 16 al 20 de agosto de 2010																7 108,3			
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																			
Saldo																			
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)																			
Saldo																			
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional																			
Saldo																			
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)																			
Saldo																			
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera																			
Saldo	259,7				259,7				259,7				259,7			259,7			
Próximo vencimiento de Repo (16 de agosto de 2010)																50,0			
Vencimientos de REPO del 16 al 20 de agosto de 2010																0,0			
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	607,8				25,2				0,0				0,0			0,0			
i. Compras (millones de US\$)	217,0				9,0														
Tipo de cambio promedio	2,8011				2,8030														
ii. Ventas (millones de US\$)																			
Tipo de cambio promedio																			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)																			
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																			
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	3 487,3				2 630,7				2 316,4				1 974,2			1 571,7			
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)																			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0090%				0,0090%				0,0090%				0,0090%			0,0090%			
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																			
Tasa de interés	3,30%				3,30%				3,30%				3,30%			3,30%			
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																			
Tasa de interés	3,30%				3,30%				3,30%				3,30%			3,30%			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	28,5				246,0				127,0				21,0			0,0			
Tasa de interés	1,70%				1,70%				1,70%				1,70%			1,70%			
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 458,8				2 384,7				2 189,4				1 953,2			1 571,7			
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	6 202,3				5 830,8				5 725,9				5 618,8			4 408,6			
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,6				10,9				10,7				10,5			8,2			
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 715,1				3 343,6				3 238,7				3 131,5			1 921,4			
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,9				6,2				6,1				5,9			3,6			
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional																			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,50/2,47				2,40/2,50/2,49				2,10/2,50/2,44				2,40/2,50/2,43			2,35/2,50/2,42			
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)																			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	85,5				64,7				81,4				104,0			102,9			
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	373,0				114,2				57,6				368,1			165,0			
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\$)	6 Agosto				9 Agosto				10 Agosto				11 Agosto			12 Agosto			
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	104,4				-127,5				84,0				119,6			-222,2			
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	58,0				-197,0				80,0				117,7			-10,9			
a. Mercado spot con el público	259,8				74,5				165,7				198,2			32,9			
i. Compras	419,0				259,7				382,6				349,9			287,6			
ii. (-) Ventas	159,2				185,1				217,0				151,7			254,7			
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	100,5				35,7				125,3				5,8			-237,0			
i. Pactadas	121,3				110,3				158,6				83,8			74,4			
ii. (-) Vencidas	20,8				74,6				33,2				78,0			311,3			
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	54,1				-33,8				121,3				4,0			-25,6			
i. Pactadas	125,6				130,1				207,3				122,7			96,6			
ii. (-) Vencidas	71,5				163,9				86,0				118,7			122,2			
d. Operaciones cambiarias interbancarias																			
i. Al contado	341,9				366,8				231,0				401,8			570,9			
ii. A futuro	35,0				215,0				58,0				30,0			30,0			
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	5,1				40,2				-15,1				-20,7			-240,5			
i. Compras	23,4				109,9				16,0				54,8			65,0			
ii. (-) Ventas	18,3				69,7				31,1				75,5			305,5			
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-156,2				-222,6				-17,8				-19,0			7,6			
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																			
Tasa de interés	2,8006				2,8008				2,8054				2,8067			2,8048			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)																			
(*) Datos preliminares																			

d. = día(s)

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

m. = mes(es)

a. = año(s)