

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ																					
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS																					
(Millones de Nuevos Soles)																					
	27 Setiembre				28 Setiembre				29 Setiembre				30 Setiembre			1 Octubre					
	8 197,3				8 787,9				8 243,9				7 952,0			7 859,2					
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	3 500,1	50,0	45,9	1 000,0	3 574,8	4 429,8	50,0	100,0	1 581,1	1 977,4	4 500,0	50,0	100,0	1 500,0	1 970,0	3 953,8	110,0	100,0	698,0	1 644,2	1 300,0
Próximos vencimientos de CD BCRP (4 de octubre de 2010)	4 212,1	140,0	329,9	1 799,0	3 574,8	4 820,2	75,0	372,9	1 691,1	1 977,4	4 702,0	115,0	229,1	1 697,5	1 970,0	3 953,8	110,0	303,0	698,0	1 644,2	1 786,3
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 7 de octubre de 2010	1,0	91,0	32,0	7,0	1,0	1,0	90,0	31,0	8,0	1,0	1,0	89,0	30,0	7,0	1,0	1,0	88,0	29,0	7,0	1,0	3,0
Tasas de interés	2,92	3,39	3,10	2,69	2,85	2,92	3,39	3,10	2,88	2,85	2,92	3,39	3,10	2,85	2,85	2,92	3,39	3,10	2,99	2,85	2,4
Máxima	3,00	3,40	3,12	3,00	3,00	3,00	3,39	3,12	3,00	3,00	3,00	3,39	3,10	3,00	3,00	3,00	3,39	3,10	3,00	3,00	3,00
Promedio	2,98	3,39	3,10	2,99	2,95	2,98	3,39	3,11	2,99	2,95	2,98	3,39	3,10	2,98	2,94	2,98	3,39	3,10	3,00	2,94	2,8
Saldo	28 945,3				29 088,8				29 731,6				29 767,6			23 911,1					
ii. Subasta de Certificados de Depósitos Realizable del BCR (CDR BCRP)																					
Saldo																2 700,0					
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																					
Saldo																9 626,7					
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	27,7				27,7				27,7				27,7			27,7					
Próximo vencimiento de Repo (18 de octubre de 2010)					8,5											8,5					
Vencimientos de REPO del 4 al 7 de octubre de 2010																					
Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	387,7				33,5				334,6				504,4			11,1					
Compras (millones de US\$)	139,0				12,0				120,0				181,0			4,0					
Compras (millones de US\$)	2 789				2 780				2 780				2 780			2 780					
b. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP																					
Compras (millones de US\$) - Tesoro Público																					
Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público																					
Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP																					
Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR																					
Compras de BTP																					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones																					
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%			0,0102%					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																					
Tasa de interés	3,80%				3,80%				3,80%				3,80%			3,80%					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																					
Tasa de interés	3,80%				3,80%				3,80%				3,80%			3,80%					
Depósitos Overnight en moneda nacional	25,0				20,6				55,0				365,7			0,0					
Tasa de interés	2,20%				2,20%				2,20%				2,20%			2,20%					
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones																					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)																					
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5 011,7				4 942,2				4 871,3				4 814,5			9 053,8					
Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,1				9,0				8,9				8,8			12,6					
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 528,2				2 458,7				2 387,9				2 331,1			6 570,4					
Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,6				4,5				4,4				4,3			9,2					
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional																					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	17,0				69,0				30,0				98,0			251,0					
Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2 952 952,95				2 952 952,95				2 952 952,95				2 852 952,91			2 952 002,95					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	27,0				314,0				103,0				114,0			29,9					
Tasa de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25/0,30/0,26				0,25/0,30/0,27				0,30/0,30/0,30				0,30/0,30/0,30			0,30/0,30/0,30					
Tasa de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 997,9				1 730,0				1 034,5				239,4			1 589,9					
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera																					
Tasa de interés: Mínima / Máxima / Promedio																					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)																					
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f																					
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f	-28,3				-7,1				16,2				-70,0			-89,0					
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f	-77,2				-19,7				-20,9				-25,9			-12,7					
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f	157,9				245,3				161,0				198,9			245,0					
a. Mercado spot con el público																					
Compras	347,3				455,3				350,7				364,7			451,4					
Ventas	189,4				210,0				169,7				167,8			206,4					
b. Mercado forward al público (con y sin entrega)																					
Compras forward al público (con y sin entrega)	53,1				13,5				58,7				1,9			32,2					
Pactadas	91,4				96,2				146,6				67,3			51,9					
Vencidas	38,3				82,7				87,9				65,4			19,6					
Ventas forward al público (con y sin entrega)	4,2				1,9				22,5				46,6			79,2					
Pactadas	110,1				160,6				225,2				192,2			209,9					
Vencidas	105,9				158,7				203,0				135,6			129,7					
c. Operaciones cambiarias interbancarias																					
Al contado	213,0				273,2				91,5				314,0			314,0					
A futuro	65,0				0,0				22,0				50,0			15,0					
Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-1,8				-40,9				-16,2				-17,1			23,8					
Compras	5,8				28,2				69,8				43,9			38,7					
Ventas	7,6				69,0				86,0				81,0			14,9					
Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-165,7				-147,2				-49,6				-134,9			-171,3					
Tasa de interés																					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	2,7870				2,7891				2,7884				2,7878			2,7870					
*) Datos preliminares																					

d = diario
s = semana(s)
m = mes(es)
a = año(s)