

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

	11 Octubre	12 Octubre	13 Octubre	14 Octubre	15 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	18 592,2	16 844,3	13 970,8	12 242,3	10 972,1
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)					
Propuestas recibidas		10 923,9	9 423,9	8 057,0	7 247,0
Plazo de vencimiento		1 500,0	1 366,9	810,0	388,0
Tasas de inte Mínima		3 676,9	1 198,0	810,0	388,0
Máxima		100,0	100,0	100,0	0,0
Promedio		150,0	250,0	600,0	250,0
Saldo		10 923,9	9 423,9	8 057,0	7 247,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (19 de octubre de 2010)		1 500,0	1 366,9	810,0	388,0
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 22 de octubre de 2010		3 676,9	1 198,0	810,0	388,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas	100,0	100,0	100,0	100,0	0,0
Plazo de vencimiento	3 m.	3 m.	3 m.	3 m.	3 m.
Tasas de inte Mínima	0	0,07	0,07	0,07	0
Máxima	0,09	0,08	0,07	0,08	0
Promedio	100,0	200,0	300,0	400,0	400,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (18 de octubre de 2010)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDV BCRP del 18 al 22 de octubre del 2010	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	4 000,0 2 743,0 710,0 6 000,0	5 000,0 3 000,0 1 048,0 3 962,2	200,0 1 500,0 999,9	999,9 750,0 1 000,0 2 032 600,0	1 000,0 1 200,0 2 000,0
Propuestas recibidas	5 815,0 2 773,0 2 674,0 7 146,2	6 925,1 4 530,0 1 053,0 3 962,2	641,0 2 602,0 2 614,0	610,8 1 101,0 1 393,0 2 032 1,6	1 051,0 1 525,0 2 621,0
Plazo de vencimiento	1 d. 31 d. 14 d. 1 d.	1 d. 31 d. 14 d. 1 d.	58 d. 33 d. 7 d.	1 d. 61 d. 32 d. 1 d.	61 d. 32 d. 3 d.
Tasas de inte Mínima	2,95 3,02 2,99 2,90	2,98 3,04 3,00 2,92	3,06 3,04 2,99	3,05 3,03 2,95	98 3,05 3,02 2,90
Máxima	3,00 3,05 3,02 3,00	3,00 3,05 3,02 3,00	3,06 3,04 3,00	3,05 3,03 3,00	100 3,07 3,04 3,00
Promedio	2,99 3,05 3,01 2,98	3,00 3,05 3,01 2,98	3,06 3,04 2,99	3,05 3,03 2,99	100 3,05 3,03 2,98
Saldo		16 462,8	18 982,8	18 982,8	19 650,9
Próximo vencimiento de Depósitos (19 octubre del 2010)		8 961,8	8 335,0	7 031,9	3 500,0
Vencimientos de Depósitos del 19 al 22 de octubre del 2009		8 961,8	8 335,0	7 031,9	6 499,9
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio	97,5	203,6	83,6	3,05	3,03
Tasas de inte Mínima	35,0	73,0	30,0	0,0	0,0
Máxima	2,7870	2,7869	2,7870	0,0000	0,0000
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					
Tipo de cambio promedio					
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	5 136,7	3 937,5	2 919,5	3 360,4	3 272,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0,0090%	0,0090%	0,0090%	0,0090%	0,0102%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	5 136,7	3 937,5	2 919,5	3 360,4	3 272,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0,0	3,0	s/m	41,0	223,0
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	82,8	2,50/2,50/2,50	237,7	2,60/2,65/2,64	2,65/3,00/2,86
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,50/1,80/1,69	1,50/2,00/1,81	1,90/3,00/2,45	3,00/3,50/3,14	3,50/6,55/5,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	1 305,4	835,0	153,9	256,5	135,9
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\$)	7 Octubre	11 Octubre	12 Octubre	13 Octubre	14 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	54,0	-74,4	42,6	29,0	-62,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	102,9	-74,2	-10,4	125,1	68,9
a. Mercado spot con el público	196,6	124,3	123,0	180,1	178,1
i. Compras	535,0	293,4	329,5	330,1	349,6
ii. (-) Ventas	338,4	169,1	206,4	149,9	171,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-24,3	-71,3	35,6	-42,8	-125,4
i. Placadas	113,5	111,5	157,5	157,7	105,6
ii. (-) Vencidas	137,8	182,8	121,9	195,6	230,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	24,6	-71,1	-17,4	53,2	5,4
i. Placadas	209,1	100,0	99,7	136,1	156,5
ii. (-) Vencidas	184,4	171,1	117,0	92,9	151,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	527,5	258,2	623,0	501,9	835,4
ii. A futuro	50,0	0,0	175,0	155,0	70,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-43,3	-176,9	-88,3	-137,6	-196,3
i. Compras	89,2	1,1	51,4	51,1	32,0
ii. (-) Ventas	132,5	178,0	119,7	188,7	228,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3,8	-33,2	-70,0	-30,1	7,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7871	2,7871	2,7867	2,7867	2,7890
8. Datos preliminares					

d. = día(s)
s. = semana(s)
m. = mes(es)
a. = año(s)