

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

	29 Octubre	26 Octubre	27 Octubre	28 Octubre	29 Octubre
	S 923,9	S 974,3	S 821,2	S 7 444,4	S 4 969,3
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>					
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
Saldo	2 656,9	2 656,9	2 656,9	2 656,9	2 311,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (29 de octubre de 2010)		345,9			1 141,0
Vencimientos de CD BCRP del 28 al 29 de octubre de 2010		345,9			0,0
ii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)	0,0	50,0	200,0	300,0	200,0
Propuestas recibidas		400,0	300,0	400,0	250,0
Plazo de vencimiento		91 d.	91 d.	91 d.	91 d.
Tasas de interés		0,10	0,10	0,10	0,10
Máxima		0,10	0,10	0,10	0,10
Promedio		0,10	0,10	0,10	0,10
Saldo	400,0	450,0	650,0	950,0	1 150,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de enero de 2011)		100,0	0,0		100,0
Vencimientos de CDV BCRP del 28 al 29 de octubre del 2010		0,0	0,0		0,0
ii. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (COLD BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	130,0	130,0	130,0	130,0	130,0
Próximo vencimiento de COLD BCRP (19 de enero de 2011)		100,0			100,0
Vencimientos de COLD BCRP del 28 al 29 de octubre del 2010		0,0			0,0
ii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	2 509,0	500,0	12,0	2 962,8	476,0
Plazo de vencimiento	3 479,5	300,0	500,0	2 961,5	3 000,0
Tasas de interés	3 238,4	305,0	834,5	2 961,5	3 000,0
Máxima	1,4	63 d.	1,4	1,4	1,4
Promedio	2,97	3,10	3,00	2,96	2,97
Saldo	3,00	3,10	3,01	3,00	3,10
Próximo vencimiento de Depósitos (28 octubre del 2010)		24 453,7			24 838,1
Vencimientos de Depósitos del 28 al 29 de octubre del 2009		6 441,0			5 730,7
ii. Compras con compromiso de Reconstrucción de moneda extranjera					
Saldo	10,5	10,5	10,5	10,5	10,0
Vencimientos de REPO del 27 al 28 de octubre de 2010		0,5			4,0
Vencimientos de REPO del 27 al 28 de octubre de 2010		0,5			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
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			0,0	0,0	0,0
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>2 463,2</b>	<b>2 383,3</b>	<b>2 250,0</b>	<b>1 933,2</b>	<b>1 769,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0090%	0,0090%	0,0090%	0,0090%	0,0085%
Tasa de interés	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
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 reposición monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%
d. Depósitos Operativos en moneda nacional					
Tasa de interés	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%	2,20%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>2 463,2</b>	<b>2 383,3</b>	<b>2 242,9</b>	<b>1 933,2</b>	<b>1 646,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/17)	2 403,5	2 403,5	2 403,5	2 403,5	2 403,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE1)*	4,3	4,3	4,3	4,3	4,3
c. Cuentas corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Cuentas corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE1)*	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CD BCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	sm	62,0	91,0	228,6	178,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		2 983,0092,98	2 983,0092,98	2 982,992,98	2 703,002,97
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	29,2	40,2	89,0	14,0	96,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,401,50/0,93	0,50/0,55/0,54	0,30/0,50/0,43	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,26
c. Total mercado secundario de CD BCRP y CD BCRP-NR	131,0	101,2	0,0	55,0	70,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>22 Octubre</b>	<b>25 Octubre</b>	<b>26 Octubre</b>	<b>27 Octubre</b>	<b>28 Octubre</b>
Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f	<b>81,5</b>	<b>-25,6</b>	<b>-9,8</b>	<b>2,1</b>	<b>-76,3</b>
Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f	<b>38,3</b>	<b>92,2</b>	<b>29,5</b>	<b>31,2</b>	<b>-10,7</b>
a. Mercado spot con el público	<b>171,4</b>	<b>178,9</b>	<b>90,7</b>	<b>105,9</b>	<b>57,2</b>
i. Compras	331,9	599,5	229,8	270,4	304,1
ii. Ventas	160,5	391,4	139,1	164,5	246,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	12,1	-45,6	-19,8	-29,6	78,1
i. Pactadas	31,2	75,8	102,2	118,7	142,0
ii. Vencidas	19,2	121,4	121,9	148,3	63,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-9,2	75,2	-28,5	-9,4	144,7
i. Pactadas	94,8	221,5	73,6	96,6	206,9
ii. Vencidas	120,3	186,3	115,1	90,0	62,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	557,5	286,4	375,0	585,0	507,0
ii. A futuro	30,0	115,0	75,0	80,0	80,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-17,9	-45,6	-48,0	-97,6	-32,8
i. Compras	0,8	54,4	39,9	31,4	27,0
ii. Ventas	17,9	120,0	120,0	129,0	59,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
g. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés	-9,3	7,7	-9,0	-29,4	-35,7
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datafeed)	2,7947	2,7927	2,7939	2,7981	2,7989

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