

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	12 Setiembre	13 Setiembre	14 Setiembre	15 Setiembre	16 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	8 026,8	7 802,5	7 691,1	6 989,7	5 936,9
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	300,0	100,0	300,0	60,0	199,9
Plazo de vencimiento	1 239,0	602,7	1 200,5	274,0	540,4
Tasas de interés: Mínima	86 d	182 d	91 d	364 d	89 d
Máxima	4,19	4,19	4,14	4,19	4,17
Promedio	4,20	4,19	4,17	4,20	4,25
Saldo	4,19	4,19	4,16	4,19	4,23
Próximo vencimiento de CD BCRP (21 de setiembre de 2011)	7 670,4	7 820,4	8 120,4	8 380,3	8 380,3
Vencimientos de CD BCRP el 16 de setiembre de 2011		600,0		600,0	600,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo	0,0	0,0		0,0	0,0
Vencimientos de Repo el 16 de setiembre de 2011					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8 309,9	8 309,9	8 309,9	8 309,9	8 309,9
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de octubre de 2011)	200,0	200,0		200,0	200,0
Vencimientos de CDV BCRP el 16 de setiembre de 2011					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	3 000,0	2 800,0	2 377,1	1 229,8	
Propuestas recibidas	3 530,4	3 008,7	2 377,1	1 229,8	
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	
Tasas de interés: Mínima	4,12	4,12	4,14	4,18	
Máxima	4,24	4,25	4,25	4,25	
Promedio	4,22	4,21	4,23	4,23	
Saldo	3 000,0	2 800,0	2 377,1	1 229,8	
Próximo vencimiento de Depósitos (16 de setiembre de 2011)		2 800,0			
Vencimientos de Depósitos el 16 de setiembre de 2011		2 800,0			
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimientos de CDR BCRP el 16 de setiembre de 2011	0,0	0,0	0,0	0,0	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					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
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	4 726,8	4 602,5	5 014,0	5 500,0	6 936,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0129%	0,0128%	0,0129%	0,0129%	0,0141%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%	3,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 726,8	4 602,5	5 014,0	5 500,0	6 886,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 731,9	7 878,2	9 538,6	9 451,3	9 460,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	15,2	12,2	14,8	14,7	14,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	6 695,9	6 359,0	6 223,9	6 137,5	6 184,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,1	7,2	9,7	9,6	9,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	829,0	579,8	681,5	655,0	1 167,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,00/4,25/4,20	4,00/4,25/4,19	4,18/4,30/4,25	4,20/4,25/4,25	4,20/4,50/4,34
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	104,7	47,0	99,9	44,0	41,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,50/1,80/1,77	0,80/1,20/0,89	0,30/0,50/0,34	0,30/0,30/0,30	0,20/0,20/0,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	954,0	441,0	900,0	933,0	780,0
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\$)	9 Setiembre	12 Setiembre	13 Setiembre	14 Setiembre	15 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	177,6	-56,9	164,2	-64,4	-33,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	204,1	26,0	264,9	10,0	66,3
a. Mercado spot con el público	215,7	2,8	285,4	17,2	105,4
i. Compras	429,4	286,0	502,1	241,7	308,0
ii. (-) Ventas	213,8	283,2	216,7	224,5	202,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-21,5	58,2	-11,8	29,7	-89,8
i. Pactadas	76,3	166,7	160,8	79,2	11,2
ii. (-) Vencidas	97,8	108,5	172,6	49,5	101,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	5,0	141,1	88,8	104,1	10,2
i. Pactadas	31,0	158,2	144,2	212,5	103,0
ii. (-) Vencidas	26,0	17,1	55,3	108,5	92,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	647,1	580,4	855,8	698,6	425,6
ii. A futuro	95,0	60,0	168,0	35,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-87,2	-68,9	-134,9	51,8	-47,4
i. Compras	8,3	6,1	32,1	88,0	48,2
ii. (-) Ventas	95,5	75,0	167,0	36,3	95,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	3,8	0,7	-2,9	0,0	0,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7272	2,7293	2,7349	2,7314	2,7307
(*) Datos preliminares					