

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	26 Setiembre	27 Setiembre	28 Setiembre	29 Setiembre	30 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	4 401,6	3 948,3	3 958,8	4 074,4	3 839,7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>		100,0		60,0	
Propuestas recibidas		284,0		199,0	
Plazo de vencimiento		168 d		350 d	
Tasas de interés: Mínima		4,18		4,18	
Máxima		4,24		4,23	
Promedio		4,23		4,21	
Saldo	7 940,3	8 040,3	8 040,3	8 100,3	8 100,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (11 de octubre de 2011)	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0	1 200,0
Vencimientos de CD BCRP del 29 al 30 de setiembre del 2011					0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>					
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
Vencimientos de Repo del 29 al 30 de setiembre del 2011					
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</u>					
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	200,0
Vencimientos de CDV BCRP del 29 al 30 de setiembre de 2011					0,0
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>					
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 Depósitos (29 de setiembre de 2011)					0,0
Vencimientos de Depósitos del 29 al 30 de setiembre de 2011		0,0		0,0	0,0
vi. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)</u>	100,0				
Propuestas recibidas	175,0				
Plazo de vencimiento	60 d				
Tasas de interés: Mínima	0,00				
Máxima	0,17				
Promedio	0,04				
Saldo	590,0	590,0	590,0	590,0	590,0
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (22 de noviembre de 2011)	490,0	490,0	490,0	490,0	490,0
Vencimientos de CDR BCRP del 29 al 30 de setiembre de 2011					0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	-515,5	0,0	-74,8	0,0	-391,0
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>	186,0		27,0		141,0
Tipo de cambio promedio	2,7715		2,7720		2,7730
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>					
ii. <u>Compras de BTP</u>					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 786,1	3 848,3	3 884,0	4 014,4	3 918,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0139%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					470,0
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%	5,05%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	296,0	638,0	415,9	943,5	529,5
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	3 490,1	3 210,3	3 468,1	3 070,9	3 389,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 141,3	9 166,0	9 022,6	8 918,2	8 853,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,1	14,2	13,9	13,8	13,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 989,9	5 827,9	5 730,9	5 650,1	5 574,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,1	9,1	8,9	8,7	8,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	1 063,5	888,0	1 443,0	1 235,0	863,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,30	4,25/4,30/4,30	4,25/4,30/4,29	4,15/4,30/4,28	4,25/4,35/4,30
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	37,0	41,0	28,9	34,0	10,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV</u>	500,0	663,0	400,0	515,4	848,6
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\$)	23 Setiembre	26 Setiembre	27 Setiembre	28 Setiembre	29 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-85,7	55,8	41,3	37,7	-96,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	16,3	23,9	-23,3	-49,6	-94,9
a. <u>Operaciones spot con el público</u>	9,9	-200,5	-23,4	-97,5	-97,8
i. <u>Compras</u>	292,8	230,2	236,5	218,7	253,1
ii. <u>(-) Ventas</u>	283,0	430,8	259,9	316,2	351,0
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	2,5	72,4	112,0	75,9	-114,1
i. <u>Pactadas</u>	44,1	111,0	116,6	135,3	112,8
ii. <u>(-) Vencidas</u>	41,6	38,6	4,7	59,4	226,9
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	104,5	40,4	47,4	-11,4	-112,3
i. <u>Pactadas</u>	119,9	208,2	80,8	107,0	98,9
ii. <u>(-) Vencidas</u>	15,4	167,8	33,5	118,5	211,1
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u>Al contado</u>	715,2	685,0	541,2	624,7	698,5
ii. <u>A futuro</u>	100,0	140,0	25,0	190,0	40,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-37,9	131,4	29,1	80,1	-12,7
i. <u>Compras</u>	2,0	166,0	32,7	107,0	210,6
ii. <u>(-) Ventas</u>	39,9	34,7	3,7	26,9	223,3
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	18,1	222,2	-0,1	26,9	-0,1
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7677	2,7707	2,7650	2,7660	2,7688
(*) Datos preliminares					