

## BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

### RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	3 Octubre	4 Octubre	5 Octubre	6 Octubre	7 Octubre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>3 453,0</b>	<b>3 252,6</b>	<b>3 361,1</b>	<b>3 824,5</b>	<b>3 664,7</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)		50,0		30,0	
Propuestas recibidas		222,0		112,4	
Plazo de vencimiento		189 d		371 d	
Tasas de interés: Mínima		4,19		4,18	
Máxima		4,20		4,19	
Promedio		4,20		4,18	
Saldo	8 100,3	8 150,3	8 150,3	8 180,3	8 180,3
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 El 7 de octubre del 2011			0,0		1 200,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	4 249,8	4 500,1	4 500,1	4 400,0	4 999,9
Propuestas recibidas	5 200,0	5 530,0	6 310,0	6 225,0	6 730,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	4,25	4,25	4,27	4,29	4,35
Máxima	4,31	4,26	4,28	4,37	4,39
Promedio	4,26	4,25	4,27	4,31	4,35
Saldo	4 249,8	4 500,1	4 500,1	4 400,0	4 999,9
Próximo vencimiento de Repo (7 de octubre de 2011)		4 500,1			4 999,9
Vencimientos de Repo El 7 de octubre del 2011					4 999,9
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	200,0
Vencimientos de CDV BCRP El 7 de octubre de 2011					799,9
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
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 (7 de octubre de 2011)					0,0
Vencimientos de Depósitos El 7 de octubre de 2011					0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCR (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
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 el 7 de octubre de 2011					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-105,5	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	38,0				
Tipo de cambio promedio	2,7760				
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>7 597,4</b>	<b>7 702,7</b>	<b>7 861,2</b>	<b>8 194,5</b>	<b>8 664,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0127%	0,0127%	0,0127%	0,0128%	0,0140%
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%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>7 597,4</b>	<b>7 702,7</b>	<b>7 861,2</b>	<b>8 194,5</b>	<b>8 664,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	8 070,9	8 614,0	9 082,4	9 450,1	9 464,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,9	13,2	14,0	14,6	14,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4 791,9	5 519,6	5 988,0	5 988,0	6 370,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	8,5	9,2	9,8	9,8
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	397,5	266,0	429,0	416,5	459,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,30/4,35/4,30	4,25/4,25/4,25	4,25/4,30/4,25	4,25/4,30/4,27	4,30/4,30/4,30
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	10,2	109,0	100,1	140,0	209,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,20/0,20	0,20/0,30/0,29	0,30/0,30/0,30	0,30/0,40/0,37	0,40/0,52/0,48
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	330,0	24,0	158,7	336,0	252,8
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>30 Setiembre</b>	<b>3 Octubre</b>	<b>4 Octubre</b>	<b>5 Octubre</b>	<b>6 Octubre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	121,6	32,0	27,4	-127,6	32,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	178,9	-10,5	-39,0	-83,1	-0,2
a. Mercado spot con el público	19,6	-14,8	-46,9	-75,2	7,6
i. Compras	340,6	232,8	205,2	246,2	254,8
ii. (-) Ventas	321,1	247,6	252,1	321,5	247,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-30,6	18,3	28,5	2,5	-13,1
i. Pactadas	39,0	41,6	69,1	48,7	74,1
ii. (-) Vencidas	69,6	23,3	40,6	46,2	87,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	26,6	-24,2	-37,9	47,0	-45,7
i. Pactadas	79,2	80,6	135,8	82,5	20,1
ii. (-) Vencidas	52,5	104,8	173,8	35,5	65,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	633,4	398,2	487,6	714,3	625,8
ii. A futuro	76,0	110,0	130,0	126,0	146,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	1,5	51,1	133,4	-24,9	-17,0
i. Compras	51,0	72,4	173,4	20,4	65,6
ii. (-) Ventas	49,5	21,3	40,0	45,3	82,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	140,7	34,7	7,7	6,4	-12,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7730	2,7739	2,7765	2,7690	2,7513
(*) Datos preliminares					