

# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

## RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	2 Noviembre	3 Noviembre	4 Noviembre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>6 575,0</b>	<b>6 594,5</b>	<b>6 849,4</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)		60,0	
Propuestas recibidas		197,2	
Plazo de vencimiento		371 d	
Tasas de interés Mínima		4,10	
Máxima		4,15	
Promedio		4,12	
Saldo	8 180,3	8 240,3	8 240,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (9 de noviembre de 2011)	1 100,0	1 100,0	1 100,0
Vencimientos de CD BCRP el 4 de noviembre del 2011			0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	1 599,9	1 400,0	1 949,9
Propuestas recibidas	3 555,5	3 319,4	4 405,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	3 d
Tasas de interés Mínima	4,25	4,27	4,31
Máxima	4,41	4,41	4,44
Promedio	4,34	4,35	4,34
Saldo	1 599,9	1 400,0	1 949,9
Próximo vencimiento de Repo (4 de noviembre de 2011)			1 949,9
Vencimientos de Repo el 4 noviembre del 2011			1 949,9
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	4 210,0	4 110,0	3 910,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (4 de noviembre de 2011)	100,0		200,0
Vencimientos de CDV BCRP el 4 de noviembre de 2011			1 010,0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	50,0	50,0	50,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP el 4 de noviembre de 2011			0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo			
Próximo vencimiento de Depósitos (4 de noviembre de 2011)			
Vencimientos de Depósitos el 4 de noviembre de 2011			
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
Próximo vencimiento de Certificados de Depósitos Reajustables (22 de noviembre de 2011)	490,0	490,0	490,0
Vencimientos de CDR BCRP el 4 de noviembre de 2011			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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
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
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>8 174,9</b>	<b>7 934,5</b>	<b>8 799,3</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0130%	0,0130%	1,4200%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	5,05%	5,05%	5,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional			
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	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>8 174,9</b>	<b>7 934,5</b>	<b>8 799,3</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	9 276,4	11 028,9	9 930,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	13,0	17,9	15,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 719,3	6 182,0	6 836,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,7	12,9	10,6
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,25/4,25	4,25/4,35/4,27	4,25/4,35/4,28
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	95,4	178,4	248,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV			
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	0,15/0,50/0,35	0,35/0,40/0,40	0,40/0,40/0,40
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	212,7	88,0	0,0
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>31 Octubre</b>	<b>2 Noviembre</b>	<b>3 Noviembre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-43,4	172,6	-41,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-3,9	100,0	-21,7
a. Mercado spot con el público	-3,0	113,0	-24,3
i. Compras	88,4	299,9	308,3
ii. (-) Ventas	91,4	186,9	332,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-89,6	106,0	-104,8
i. Pactadas	8,5	266,6	63,0
ii. (-) Vencidas	98,1	160,6	167,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-50,0	33,4	-85,3
i. Pactadas	4,9	132,6	233,5
ii. (-) Vencidas	54,9	99,2	318,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	0,0	347,3	569,8
ii. A futuro	0,0	190,0	87,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-44,1	-74,0	153,7
i. Compras	49,8	59,4	311,2
ii. (-) Ventas	93,8	133,4	157,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-0,4	-0,1
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,7059	2,7110	2,7082
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Cambiarias - Unidad Ejecutora