

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Nuevos Soles)

	7 Noviembre	8 Noviembre	9 Noviembre	10 Noviembre	11 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 073,6	7 362,2	9 012,9	9 048,6	8 731,1
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)		100,0	300,0	60,0 300,0	500,1
Propuestas recibidas		520,0	1 555,0	206,3 1 211,3	1 692,6
Plazo de vencimiento		189 d	92 d	364 d 91 d	90 d
Tasas de interés: Mínima		4,10	4,01	4,09 4,00	4,00
Máxima		4,13	4,10	4,10 4,06	4,05
Promedio		4,11	4,05	4,10 4,03	4,02
Saldo	8 240,3	8 340,3	7 540,3	7 900,3	8 400,4
Próximo vencimiento de CD BCRP (15 de noviembre de 2011)	1 100,0		250,1	250,1	250,1
Vencimientos de CD BCRP el 11 de noviembre del 2011	0,0				0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	1 699,9	1 200,0			
Propuestas recibidas	2 420,0	1 630,0			
Plazo de vencimiento	1 d	1 d			
Tasas de interés: Mínima	4,30	4,25			
Máxima	4,42	4,30			
Promedio	4,33	4,27			
Saldo	1 699,9	1 200,0			
Próximo vencimiento de Repo (11 de noviembre de 2011)	1 699,9				
Vencimientos de Repo el 11 de noviembre del 2011	1 699,9				
iii. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 710,0	3 510,0	3 310,0	3 010,0	2 900,0
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de noviembre de 2011)					300,0
Vencimientos de CDV BCRP el 11 de noviembre de 2011					2 100,0
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	50,0	50,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (14 diciembre de 2011)	50,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDLD BCRP el 11 de noviembre de 2011					0,0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			500,0	1 500,0	2 000,1
Propuestas recibidas			2 332,1	4 457,0	4 370,4
Plazo de vencimiento			1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima			3,90	4,00	3,90
Máxima			4,15	4,08	4,05
Promedio			4,07	4,06	3,98
Saldo			500,0	1 500,0	2 000,1
Próximo vencimiento de Depósitos (11 de noviembre de 2011)				1 500,0	2 000,1
Vencimientos de Depósitos el 11 de noviembre de 2011				1 500,0	2 000,1
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 11 de noviembre de 2011					0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	5,4	378,4	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	2,0	140,0			
Tipo de cambio promedio	2,7040	2,7030			
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	8 778,9	8 840,6	8 212,9	7 188,6	6 230,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	1,0130%	1,0130%	1,0130%	1,0130%	1,0420%
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	80,0	106,0	7,0
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	8 778,9	8 840,6	8 132,9	7 082,6	6 223,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	10 769,1	10 567,1	11 042,5	11 038,1	10 978,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	16,7	16,4	17,2	17,1	17,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	7 277,3	7 925,0	8 039,4	8 049,8	7 883,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,9	11,6	12,3	12,3	12,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	447,5	704,0	447,1	296,1	292,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,30/4,28	4,30/4,30/4,30	4,25/4,30/4,28	4,15/4,25/4,25	4,15/4,25/4,24
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	204,0	86,0	212,0	258,0	195,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,40/0,40/0,40	0,40/0,40/0,40	0,40/0,40/0,40	0,30/0,40/0,36	0,30/0,40/0,32
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	20,0	65,5	97,7	70,0	7,0
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\$)	4 Noviembre	7 Noviembre	8 Noviembre	9 Noviembre	10 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	106,7	-60,6	-68,6	127,8	58,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	29,3	22,3	-37,7	75,8	124,3
a. Mercado spot con el público	33,1	22,7	109,7	77,0	124,2
i. Compras	352,4	276,8	336,2	299,5	371,2
ii. (-) Ventas	319,3	254,1	226,5	222,5	246,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	132,5	-17,2	151,7	-145,1	16,6
i. Pactadas	152,3	107,6	208,0	93,4	76,0
ii. (-) Vencidas	19,9	124,8	56,2	238,6	59,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	55,1	65,6	182,6	-197,1	82,3
i. Pactadas	132,4	224,5	337,5	367,7	139,2
ii. (-) Vencidas	77,3	158,8	154,9	564,8	56,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	216,0	173,8	251,9	505,0	336,0
ii. A futuro	71,0	20,0	43,0	138,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	57,9	35,6	86,2	324,5	3,6
i. Compras	68,7	156,0	141,5	560,6	56,6
ii. (-) Ventas	10,9	120,4	55,4	236,1	53,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,2	-2,0	-135,0	0,6	-6,2
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés	2,7072	2,7035	2,7027	2,7074	2,7080
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)					
(*) Datos preliminares					