

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones S/.)

	03 Noviembre	04 Noviembre	05 Noviembre	06 Noviembre	07 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 545,6	1 810,3	1 918,2	3 758,5	3 138,3
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)					
Saldo	--	--	--	--	--
Próximo vencimiento de CDBCRP (06 noviembre del 2008)	10 268,4	10 268,4	10 264,4	9 109,4	9 109,4
Vencimientos de CDBCRP del 05 al 07 de noviembre del 2008		0,0			1 388,0
					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	50,0	20,0	2 000,0	1 050,0	2 000,0
Propuestas recibidas	175,0	3 430,0	3 360,0	2 060,0	3 450,0
Plazo de vencimiento	1 a.	3 m.	1 d.	1 a.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	7,01	6,57	6,56	6,56	6,61
Máxima	7,01	6,63	6,62	6,61	6,68
Promedio	7,01	6,60	6,58	6,57	6,64
Saldo	9 033,1	9 053,1	10 053,1	7 903,1	7 353,1
Próximo vencimiento de Repo (05 noviembre del 2008)					1 250,0
Vencimientos de Repo del 05 al 07 de noviembre del 2008					5 150,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)					
Propuestas recibidas	--	--	--	--	--
Plazo de vencimiento	--	--	--	--	--
Tasas de interés: Mínima	--	--	--	--	--
Máxima	--	--	--	--	--
Promedio	--	--	--	--	--
Saldo	2 915,0	2 915,0	2 915,0	2 915,0	2 915,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (07 de enero del 2009)					465,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Saldo	283,0	283,0	283,0	283,0	283,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Saldo	12 108,0	12 108,0	12 108,0	9 779,2	9 779,2
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (06 de noviembre de 2008)					2 174,1
Vencimientos de CDBCRP del 05 al 07 de noviembre del 2008					0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera	150,0	300,0	300,0	300,0	--
Propuestas recibidas	150,0	355,0	489,1	338,5	--
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	6,51	6,55	6,55	6,55	--
Máxima	6,61	6,55	6,61	6,61	--
Promedio	6,54	6,55	6,57	6,56	--
Saldo	150,0	300,0	300,0	300,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo (05 noviembre del 2008)	150,0				0,0
Vencimientos de Repo del 05 al 07 de noviembre del 2008	150,0				0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-43,1	0,0	0,0	-441,8	-9,3
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	14,0			143,0	3,0
Tipo de cambio promedio	3,0804			3,0893	3,0890
c. Operaciones con el Tesoro Público					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	24,2
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	-9,8	0,0	-4,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	9,8		4,0		
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 712,3	4 130,3	5 222,2	5 666,7	5 629,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0147%	0,0147%	0,0179%	0,0179%	0,0179%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	35,0	25,0	25,0	25,0	660,0
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 677,3	4 105,3	5 197,2	5 641,7	4 969,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 815,2	4 332,4	6 975,8	7 049,8	7 006,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	10,0	11,0	17,3	17,3	17,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 036,6	2 553,8	5 197,2	5 271,3	5 228,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,4	6,5	12,9	12,9	12,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	130,0	104,5	122,3	334,1	488,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,50/6,75/6,55	6,50/6,75/6,59	6,50/6,60/6,55	6,50/6,70/6,55	6,50/6,60/6,52
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	15,5	43,2	67,5	40,8	53,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,80/1,10/0,90	0,80/1,90/1,36	1,00/1,25/1,06	0,90/1,20/1,02	0,70/1,10/0,90
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	77,4	12,9	44,0	166,9	10,5
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\$)	31 Octubre	31 Octubre	04 Noviembre	05 Noviembre	06 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	31,6	31,6	-45,1	32,9	89,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-25,3	-25,3	-145,3	-42,2	3,4
a. Mercado spot con el público	-118,8	-118,8	-128,9	-43,4	-17,5
i. Compras	193,6	193,6	83,8	162,9	157,1
ii. (-) Ventas	312,4	312,4	212,7	206,3	174,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-1,4	-1,4	35,4	80,1	-265,1
i. Pactadas	168,9	168,9	238,0	148,0	23,9
ii. (-) Vencidas	170,3	170,3	202,7	67,8	289,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-58,3	-58,3	-64,8	5,0	-351,6
i. Pactadas	129,3	129,3	152,2	46,7	72,0
ii. (-) Vencidas	187,6	187,6	217,0	41,6	423,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	139,3	139,3	215,5	166,9	164,6
ii. A futuro	66,0	66,0	39,0	17,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	23,5	23,5	14,0	-25,1	-3,5
i. Compras	184,1	184,1	214,5	41,3	246,1
ii. (-) Ventas	160,6	160,6	200,5	66,4	249,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	87,3	87,3	-16,0	0,0	159,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,0843	3,0843	3,0745	3,0742	3,0881
(*) Datos preliminares					