

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ																	
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS																	
(Millones de Nuevos Soles)																	
	26 Octubre				27 Octubre				28 Octubre				29 Octubre		30 Octubre		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 923,5				1 800,0				2 139,4				1 837,7		1 767,6		
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)	400,2	3,0	300,0	781,7	399,9	3,0	300,0	800,0	800,0	49,5	400,0	619,5	981,6	262,0	268,9	631,7	700,0
Propuestas recibidas	734,7	53,0	620,0	781,7	850,9	109,0	355,5	852,8	816,7	59,5	540,0	619,5	991,6	362,0	268,9	731,7	846,3
Plazo de vencimiento	1 d.	263 d.	179 d.	1 d	1 d.	262 d.	177 d.	1 d	1 d.	1 d.	182 d.	1 d.	1 d.	182 d.	1 d.	1 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	1,16	1,30	1,25	1,01	1,12	1,30	1,25	1,05	1,16	1,20	1,25	1,05	1,16	1,26	1,01	1,20	1,09
Máxima	1,20	1,30	1,26	1,23	1,20	1,30	1,27	1,23	1,23	1,23	1,26	1,23	1,23	1,28	1,23	1,24	1,24
Promedio	1,20	1,30	1,25	1,11	1,16	1,30	1,26	1,13	1,19	1,23	1,26	1,17	1,22	1,26	1,18	1,22	1,17
Saldo	15 284,6				15 605,6				15 774,7				15 818,2		15 899,4		
Próximo vencimiento de CD BCRP (2 de noviembre del 2009)															1 831,7		
Vencimientos de CD BCRP del 2 al 6 de noviembre del 2009															2 681,7		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																	
Saldo	109,1				109,1				109,1				109,1		109,1		
Próximo vencimiento de Repo (20 de noviembre del 2009)															109,1		
Vencimientos de CD BCRP del 2 al 6 de noviembre del 2009															0,0		
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDR BCRP)																	
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0		0,0		
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional																	
Saldo	0,0				0,0				0,0				0,0		0,0		
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)																	
Saldo	230,5				230,5				230,5				230,5		230,5		
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (20 de noviembre del 2009)															0,0		
Vencimientos de CD BCRP del 2 al 6 de noviembre del 2009															0,5		
vi. Compra con compromiso de Recompensa de moneda extranjera																	
Saldo	289,0				289,0				289,0				289,0		289,5		
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)															39,8		
Vencimientos de Repo del 2 al 6 de noviembre del 2009															0,0		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0				0,0				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				-30,0		-69,7		
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	438,6				297,1				270,4				325,2		435,9		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																	
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)																	
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0053%				0,0052%				0,0052%				0,0052%		0,0052%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																	
Tasa de interés	2,05%				2,05%				2,05%				2,05%		75,0		
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																	
Tasa de interés	2,05%				2,05%				2,05%				2,05%		2,05%		
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	184,2				39,0				32,5				6,5		17,3		
Tasa de interés	0,45%				0,45%				0,45%				0,45%		0,45%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	254,4				258,1				237,9				318,7		343,6		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 868,5				2 850,7				2 833,4				2 820,1		2 808,5		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6				6,6				6,5				6,5		6,4		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	739,3				721,4				704,2				690,9		679,3		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7				1,7				1,6				1,6		1,6		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																	
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	534,0				468,0				308,0				403,5		421,4		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,15/1,25/1,25				1,15/1,25/1,20				1,15/1,25/1,18				1,15/1,30/1,23		1,20/1,30/1,24		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	219,0				198,0				98,5				154,3		166,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,80/0,80/0,80				0,31/0,80/0,73				0,55/0,73/0,59				0,30/0,55/0,33		0,25/0,30/0,27		
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	143,6				50,0				0,0				0,0		174,0		
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\$)	23 Octubre				26 Octubre				27 Octubre				28 Octubre		29 Octubre		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	10,0				20,0				-144,1				-6,7		-105,5		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	110,4				34,9				-59,8				11,5		-51,6		
a. Mercado spot con el público	119,3				35,8				-49,9				12,2		-23,1		
i. Compras	246,0				211,4				210,1				156,2		177,6		
ii. (-) Ventas	126,7				175,5				260,1				144,0		200,7		
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-48,3				90,2				-48,7				-43,8		-114,3		
i. Pactadas	73,9				141,1				115,7				166,8		246,1		
ii. (-) Vencidas	122,1				51,0				164,4				210,6		360,3		
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	52,1				105,1				35,6				-25,6		-60,3		
i. Pactadas	103,7				215,8				125,3				170,1		133,9		
ii. (-) Vencidas	51,6				110,7				89,7				195,8		194,2		
d. Operaciones cambiarias interbancarias																	
i. Al contado	348,3				351,0				362,0				265,0		363,2		
ii. A futuro	20,0				93,0				63,0				58,0		43,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-69,5				46,8				-76,6				-12,6		-164,6		
i. Compras	45,7				90,6				87,7				195,7		182,9		
ii. (-) Ventas	115,1				43,8				164,2				208,2		347,5		
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-10,0				12,0				-8,0				-3,0		-30,0		
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																	
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8692				2,8797				2,8995				2,9061		2,8940		
(*) Datos preliminares																	