

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	30 Noviembre	1 Diciembre	2 Diciembre	3 Diciembre	4 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 733,4	1 707,7	1 619,0	1 692,1	1 715,6
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)					
Propuestas recibidas	500,0 900,0	378,7	300,0	299,9	199,4
Plazo de vencimiento	880,1 948,4	378,7	315,0	409,6	199,4
Tasas de interés:					
Mínima	1,05 1,05	1,05	1,20	1,12	1,13
Máxima	1,20 1,23	1,23	1,23	1,23	1,24
Promedio	1,14 1,16	1,14	1,22	1,19	1,20
Saldo	15 537,3	14 516,0	14 437,3	14 437,2	14 336,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (7 de diciembre del 2009)					599,4
Vencimientos de CD BCRP del 7 al 11 de diciembre del 2009					1 799,3
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Saldo	293,5	293,5	293,5	293,5	293,5
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)					39,8
Vencimientos de Repo del 7 al 11 de diciembre 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	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	363,4	1 336,0	1 328,2	1 417,7	1 534,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0053%	0,0053%	0,0053%	0,0053%	0,0053%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%	2,05%
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					
Tasa de interés	53,4	90,0	54,0	0,0	30,0
	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	310,0	1 246,0	1 274,2	1 417,7	1 504,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 821,3	3 401,9	3 416,0	3 388,8	3 436,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	9,1	9,1	7,5	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	665,4	1 246,0	1 260,1	1 312,6	1 360,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,5	3,3	3,4	2,9	3,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	631,5	584,0	586,0	630,0	919,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,20/1,25/1,24	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,20/1,25/1,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	141,3	157,0	126,0	131,0	154,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	140,0	375,5	257,9	310,0	41,0
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\$)	27 Noviembre	30 Noviembre	1 Diciembre	2 Diciembre	3 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	37,9	-58,4	-144,8	29,8	79,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-36,3	1,1	56,1	34,9	103,9
a. Mercado spot con el público	17,5	14,1	57,9	44,2	108,8
i. Compras	179,4	302,0	243,0	180,6	237,4
ii. (-) Ventas	161,8	287,9	185,2	136,5	128,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	125,4	-156,4	7,6	-23,1	-35,2
i. Pactadas	131,6	148,0	162,7	150,2	216,8
ii. (-) Vencidas	6,2	304,4	155,1	173,3	251,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	51,2	-96,9	208,4	-17,9	-10,3
i. Pactadas	138,9	168,2	368,1	86,0	274,4
ii. (-) Vencidas	87,8	265,1	159,7	103,9	284,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	423,2	474,5	469,0	219,0	275,4
ii. A futuro	18,0	12,0	58,0	18,0	55,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	58,7	-52,3	-10,2	-83,7	36,9
i. Compras	61,3	239,8	143,2	85,8	271,4
ii. (-) Ventas	2,6	292,1	153,4	169,5	234,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-31,0	0,0	13,0	5,0	-9,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8868	2,8800	2,8752	2,8790	2,8752
(*) Datos preliminares					