

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU																					
OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS																					
(Millones S/.)																					
	19 Octubre			20 Octubre			21 Octubre			22 Octubre			23 Octubre								
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 868,8			2 602,5			2 936,3			1 625,5			1 519,6								
4. 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	1 356,0	1 042,0	126,0	1 100,0	1 389,9	1 824,0	250,2	878,0	1 283,6	1 792,8	250,2	878,0	1 283,6	511,9	159,0	113,0	350,0	300,0	400,0	100,0	750,1
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	273 d.	92 d.	1 d.	1 d.	272 d.	182 d.	1 d.	1 d.	272 d.	182 d.	1 d.	1 d.	270 d.	1 d.	1 d.	3 d.	182 d.	3 d.	3 d.
Tasas de interés: Mínima	0,98	1,09	1,28	1,23	0,94	1,09	1,28	1,25	1,05	1,05	1,28	1,25	1,05	1,05	1,29	1,25	1,01	1,01	1,13	1,26	1,03
Máxima	1,16	1,16	1,28	1,24	1,12	1,16	1,28	1,26	1,09	1,12	1,28	1,26	1,09	1,23	1,29	1,29	1,12	1,09	1,23	1,26	1,24
Promedio	1,10	1,13	1,28	1,24	1,07	1,12	1,28	1,25	1,06	1,10	1,28	1,25	1,06	1,12	1,29	1,26	1,09	1,03	1,20	1,26	1,09
Saldo	14 886,8			15 186,5			15 386,7			15 261,6			15 349,8								
Próximo vencimiento de CD BCRP (26 de octubre del 2009)													1 550,1								
Vencimientos de CD BCRP del 26 al 30 de octubre del 2009													2 050,1								
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)																					
Propuestas recibidas																					
Plazo de vencimiento																					
Tasas de interés: Mínima																					
Máxima																					
Promedio																					
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 26 al 30 de octubre 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								
Próximo vencimiento de CDR BCRP													0,0								
Vencimientos de CDR BCRP del 12 al 16 de octubre del 2009													0,0								
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional																					
Saldo	0,0			0,0			0,0			0,0			0,0								
Próximo vencimiento de Depósitos (06 enero del 2009)													0,0								
Vencimientos de Depósitos del 06 al 09 de enero del 2009													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)													230,5								
Vencimientos de CD BCRP del 26 al 30 de octubre del 2009													0,0								
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera																					
Propuestas recibidas																					
Plazo de vencimiento																					
Tasas de interés: Mínima																					
Máxima																					
Promedio																					
Saldo	280,3			280,3			280,3			280,3			289,0								
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)													39,8								
Vencimientos de Repo del 26 al 30 de octubre del 2009													0,0								
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	262,4			160,0			0,0			0,0			0,0								
i. Compras (millones de US\$)	92,0			56,0			0,0			0,0			0,0								
Tipo de cambio promedio	2,8526			2,8568																	
ii. Ventas (millones de US\$)	2,9																				
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																					
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	486,1			532,7			114,3			280,6			269,5								
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	40,5			185,5			29,3			32,5			62,2								
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	445,6			347,2			85,0			248,1			207,3								
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 058,9			3 025,8			2 991,0			2 963,1			2 935,8								
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,1			7,0			6,9			6,9			6,8								
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	929,7			900,6			861,7			833,8			806,6								
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2			2,1			2,0			1,9			1,9								
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	286,0			529,0			315,7			681,2			630,5								
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,00/1,15/1,13			1,05/1,15/1,10			1,05/1,10/1,11			1,00/1,15/1,15			1,09/1,25/1,24								
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	144,3			227,5			392,5			224,0			254,0								
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,80/0,90/0,85			0,80/0,85/0,85			0,70/0,85/0,81			0,80/0,85/0,80			0,80/0,85/0,80								
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	365,2			0,0			0,0			173,6			29,5								
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\$)																					
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	43,5			-28,5			-22,6			-22,7			-22,7								
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-23,2			-33,8			-24,3			-13,9			60,0								
a. Mercado spot con el público	-19,2			-59,0			13,0			-85,1			-68,0								
i. Compras	216,3			257,7			254,8			250,3			248,4								
ii. (-) Ventas	235,5			105,8			224,7			225,2			180,4								
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	318,7			-2,1			101,1			-23,6			-200,0								
i. Pactadas	435,5			187,7			285,2			193,4			138,9								
ii. (-) Vencidas	116,8			189,7			184,1			216,9			338,9								
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-41,1			-7,3			-24,2			-85,9			-117,3								
i. Pactadas	125,1			122,8			149,1			157,6			101,2								
ii. (-) Vencidas	84,0			130,2			124,9			70,7			218,5								
d. Operaciones cambiarias interbancarias																					
i. Al contado	374,6			230,1			484,0			340,7			539,9								
ii. A futuro	40,0			105,0			20,0			80,0			31,0								
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-23,7			-55,4			-59,6			-148,7			-148,9								
i. Compras	80,5			117,6			123,7			65,8			215,3								
ii. (-) Ventas	104,2			173,0			183,3			214,5			329,2								
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-224,0			-97,0			-37,0			-46,5			-14,5								
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8543			2,8522			2,8617			2,8570			2,8623								
(*) Datos preliminares																					

d. = día(s)  
s. = semana(s)  
m. = mes(es)  
a. = año(s)