

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS (Millones de Nuevos Soles)						
	29 Noviembre		30 Noviembre	1 Diciembre	2 Diciembre	3 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	7 126,6		6 881,0	7 302,8	7 783,7	8 223,9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones	1 170,0		1 170,0	1 170,0	1 170,0	1 170,0
Saldo	1 170,0		1 170,0	1 170,0	1 170,0	1 170,0
Próximo vencimiento de CD BCRP (10 de diciembre de 2010)				650,0		650,0
Vencimientos de CD BCRP del 6 al 10 de diciembre de 2010				0,0		0,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)</u>	100,0		100,0			
Propuestas recibidas	413,0		125,0			
Plazo de vencimiento	182 d.		182 d.			
Tasas de inte Mínima	0,04		0,06			
Máxima	0,07		0,09			
Promedio	0,04		0,08			
Saldo	2 022,9		2 122,9	2 122,9	2 122,9	2 122,9
Próximo vencimiento de CDV BCRP (11 de enero de 2011)				100,0		100,0
Vencimientos de CDV BCRP del 6 al 10 de diciembre del 2010				0,0		0,0
iv. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCRP (CDLD BCRP)</u>	450,0		450,0	450,0	450,0	450,0
Propuestas recibidas				100,0		100,0
Plazo de vencimiento				0,0		0,0
Tasas de inte Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	450,0		450,0	450,0	450,0	450,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP (19 de enero de 2011)				100,0		100,0
Vencimientos de CDLD BCRP del 6 al 10 de diciembre del 2010				0,0		0,0
v. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	200,1	2 000,1	100,0	3 243,5	2 000,0	3 173,3
Propuestas recibidas	281,4	2 482,8	162,0	3 243,5	3 271,9	3 173,3
Plazo de vencimiento	115 d.	1 d.	64 d.	1 d.	1 d.	1 d.
Tasas de inte Mínima	3,22	2,99	3,06	2,92	2,97	2,92
Máxima	3,22	3,00	3,07	3,00	3,00	3,00
Promedio	3,22	2,99	3,07	2,99	2,99	2,98
Saldo	24 137,6		24 067,3	18 031,1	18 481,1	18 731,2
Próximo vencimiento de Depósitos (6 diciembre del 2010)				500,0		2 500,2
Vencimientos de Depósitos del 6 al 10 de diciembre del 2009				799,9		3 976,7
vi. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u>	6,0		6,0	6,0	6,0	6,0
Saldo	6,0		6,0	6,0	6,0	6,0
Próximo vencimiento de Repo (20 de diciembre de 2010)				0,0		0,0
Vencimientos de REPO del 6 al 10 de diciembre de 2010				0,0		0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	0,0		0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>						
Tipo de cambio promedio						
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>						
Tipo de cambio promedio						
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	0,0		0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>						
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>						
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>						
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>						
ii. <u>Compras de BTP</u>						
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 482,9		1 607,7	7 302,8	6 833,7	6 723,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones	0,0089%		0,0089%	0,0089%	0,0089%	0,0089%
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>						
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0089%		0,0089%	0,0089%	0,0089%	0,0089%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>						
Tasa de interés	3,80%		3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>						
Tasa de interés	3,80%		3,80%	3,80%	3,80%	3,80%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	5,3		94,9	694,7	208,7	0,0
Tasa de interés	2,20%		2,20%	2,20%	2,20%	2,20%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 477,6		1 512,8	6 608,1	6 625,0	6 723,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 483,5		2 483,5	2 483,5	2 483,5	2 462,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,1		4,1	3,7	4,1	4,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	0,0		0,0	0,0	0,0	0,0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	0,0		0,0	0,0	0,0	0,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP	370,0		295,5	555,5	849,0	574,6
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	2,95/3,00/3,00		3,00/3,00/3,00	2,90/3,00/2,97	2,75/3,00/2,94	2,75/2,95/2,94
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	19,0		10,0	76,3	111,9	89,4
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	0,20/0,20/0,20		0,25/0,25/0,25	0,40/1,30/1,12	1,75/2,05/1,86	1,95/2,05/2,00
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	187,0		255,6	582,0	877,0	696,0
c. <u>Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV</u>						
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\$)	26 Noviembre		29 Noviembre	30 Noviembre	1 Diciembre	2 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	126,8		-57,2	-6,4	-65,5	14,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	12,1		28,0	-75,6	-49,1	-32,0
a. <u> Mercado spot con el público</u>	52,7		13,9	-9,1	-6,5	12,7
i. <u>Compras</u>	243,2		265,4	297,0	191,9	247,2
ii. (-) <u>Ventas</u>	190,6		251,6	306,1	198,4	234,5
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	89,9		8,9	82,6	-20,0	-57,8
i. <u>Pactadas</u>	191,4		169,3	182,8	193,8	86,1
ii. (-) <u>Vencidas</u>	101,5		160,4	100,2	213,8	143,9
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-24,8		94,1	13,4	-3,5	-104,4
i. <u>Pactadas</u>	81,7		123,7	125,5	172,6	43,5
ii. (-) <u>Vencidas</u>	106,5		29,6	112,1	176,1	147,9
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>						
i. <u>Al contado</u>	304,5		442,1	382,6	563,1	388,2
ii. <u>A futuro</u>	65,0		80,0	25,0	85,0	216,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-47,2		-89,6	-22,5	-61,0	-31,7
i. <u>Compras</u>	49,0		18,6	76,5	151,5	111,4
ii. (-) <u>Ventas</u>	96,3		108,2	99,0	212,5	143,0
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	11,7		-27,0	-32,1	-19,3	-9,1
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8162		2,8266	2,8325	2,8272	2,8273
(*) Datos preliminares						

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