

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

	21 Noviembre	22 Noviembre	23 Noviembre			24 Noviembre	25 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	187,3	5,2	291,5			36,3	-61,4
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones							
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>							
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>	0,0	15,0 1/	15,0 2/	35,0	50,0	55,0	0,0
Propuestas recibidas		45,0	45,0	106,0	122,0	65,0	
Plazo de vencimiento		2 años	2 años	1 año	6 meses	1 semana	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		5,20/5,32/5,30	5,20/5,32/5,30	4,30/4,35/4,32	3,85/3,89/3,87	3,08/3,10/3,09	
Saldo	8 905,3	8 905,3	8 695,3			8 671,3	8 671,3
Próximo vencimiento de CDBCRP (23 de noviembre de 2005)						55,0	
Vencimientos de CDBCRP del 23 al 25 de noviembre de 2005						55,0	
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>	0,0	70,0	0,0			30,0	180,0
Propuestas recibidas		128,1				71,0	210,0
Plazo de vencimiento		1 día				1 día	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		3,02/3,08/3,04				3,05/3,09/3,08	3,11/3,12/3,11
Saldo		70,0				30,0	180,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>	0,0	0,0	0,0			0,0	0,0
Propuestas recibidas							
Plazo de vencimiento							
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio							
Saldo	170,0	170,0	170,0			170,0	170,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (14 diciembre de 2005)	50,0	50,0	50,0			50,0	50,0
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							
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	187,3	75,2	136,5			66,3	118,6
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones							
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>							
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0045%	0,0045%	0,0045%			0,0045%	0,0045%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>							
Tasa de interés	3,75%	3,75%	3,75%			3,75%	3,75%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>							
Tasa de interés							
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	100,0	25,0	60,0			0,0	11,5
Tasa de interés	2,25%	2,25%	2,25%			2,25%	2,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	87,3	50,2	76,5			66,3	107,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 371,8	1 356,5	1 343,8			1 331,7	1 322,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5	7,4	7,3			7,2	7,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	385,3	370,0	357,3			345,2	335,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,0	1,9			1,9	1,8
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP							
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	100,3	147,9	153,0			354,7	133,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,90/3,05/3,00	2,95/3,05/3,00	2,90/3,05/2,96			3,00/3,05/3,04	3,00/3,10/3,04
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	6,5	6,5	3,5			6,5	4,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,05/4,10/4,08	4,05/4,08/4,07	4,08/4,08/4,08			4,05/4,08/4,08	4,08/4,08/4,08
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	12,0	43,8	67,5			30,6	87,0
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\$)	18 Noviembre	21 Noviembre	22 Noviembre			23 Noviembre	24 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	23,5	-4,8	6,5			-9,8	-14,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	35,8	13,5	50,8			19,7	31,0
a. <u>Mercado spot con el público</u>	27,4	0,8	6,5			18,4	37,3
i. Compras	109,1	92,9	79,3			83,0	88,4
ii. (-) Ventas	81,7	92,1	72,7			64,5	51,1
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-0,8	-7,3	-31,0			-9,3	6,3
i. Pactadas	18,4	21,9	71,1			19,3	21,7
ii. (-) Vencidas	19,2	29,2	102,1			28,6	15,4
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	11,6	11,1	13,3			20,2	51,6
i. Pactadas	29,3	26,1	23,7			35,1	68,3
ii. (-) Vencidas	17,8	15,1	10,3			14,9	16,7
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>							
i. Al contado	79,0	64,3	74,4			48,3	93,6
ii. A futuro	1,0	6,0	8,0			13,0	17,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-3,6	-21,5	-54,0			-12,0	-10,0
i. Compras	15,4	2,5	5,5			14,0	1,0
ii. (-) Ventas	19,0	24,0	59,5			26,0	11,0
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	10,5	20,0	6,5			-0,5	5,0
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>							
Tasa de interés							
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,383	3,385	3,391			3,389	3,396
(*) Datos preliminares							

1/ Estos CD BCRP se emiten al siguiente día útil.

2/ Estos CD BCRP se subastaron el día útil previo.