

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

	5 Diciembre	6 Diciembre	7 Diciembre	9 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	13,0	40,9	-110,2	-131,6
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>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				
Saldo	8 616,3	8 616,3	8 616,3	8 616,3
Próximo vencimiento de CDBCRP (12 de diciembre de 2005)				520,0
Vencimientos de CDBCRP del 7 al 9 de diciembre de 2005				520,0
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>	<u>500,0</u>	<u>400,0</u>	<u>460,0</u> <u>100,0</u>	<u>560,0</u>
Propuestas recibidas	809,0	622,0	782,0 100,0	952,0
Plazo de vencimiento			2 días 2 días	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,38/3,39/3,38	3,38/3,40/3,38	3,34/3,45/3,39 3,37/3,37/3,37	3,31/3,38/3,36
Saldo	610,0	470,0	560,0	560,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				
Saldo	170,0	170,0	170,0	170,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (14 diciembre de 2005)	50,0	50,0	50,0	50,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	<u>0,0</u>	<u>20,5</u>	<u>10,2</u>	<u>8,5</u>
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>				
Tipo de cambio promedio				
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>		6,0	3,0	2,5
Tipo de cambio promedio		3,4134	3,4130	3,4130
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	513,0	420,4	439,6	419,9
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)	0,0044%	0,0044%	0,0052%	0,0044%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>				
Tasa de interés				
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>37,0</u>	<u>3,8</u>	<u>1,2</u>	<u>7,4</u>
Tasa de interés	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	476,0	416,6	438,4	412,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 553,1	1 527,4	1 512,2	1 489,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,4	8,2	8,1	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	570,5	544,9	529,7	506,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,1	2,9	2,9	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>182,0</u>	<u>196,2</u>	<u>292,6</u>	<u>334,3</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,15/3,35/3,30	3,25/3,35/3,32	3,30/3,45/3,34	3,30/3,45/3,35
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>20,0</u>	<u>30,0</u>	<u>33,0</u>	<u>37,6</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,13/4,13/4,13	4,13/4,15/4,13	4,13/4,15/4,13	4,13/4,15/4,13
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	<u>10,0</u>	<u>36,0</u>	<u>68,3</u>	<u>3,0</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\$)	2 Diciembre	5 Diciembre	6 Diciembre	7 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-6,1	-29,8	-10,0	-26,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-0,9	-24,3	12,4	-53,5
a. <u> Mercado spot con el público</u>	<u>-8,8</u>	<u>-18,4</u>	<u>5,6</u>	<u>-45,4</u>
i. Compras	78,9	67,5	84,6	84,6
ii. (-) Ventas	87,7	85,9	78,9	130,0
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>17,3</u>	<u>-32,7</u>	<u>-11,2</u>	<u>-5,6</u>
i. Pactadas	77,8	18,2	17,3	25,5
ii. (-) Vencidas	60,5	51,0	28,5	31,2
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>22,4</u>	<u>-27,3</u>	<u>11,2</u>	<u>-32,3</u>
i. Pactadas	25,1	6,6	20,2	14,7
ii. (-) Vencidas	2,7	33,9	9,0	46,9
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	112,5	55,5	80,5	71,0
ii. A futuro	17,0	0,0	15,0	10,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-52,0</u>	<u>-25,0</u>	<u>-12,9</u>	<u>-3,4</u>
i. Compras	0,0	16,0	7,0	24,6
ii. (-) Ventas	52,0	41,0	19,9	28,0
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>2,0</u>	<u>2,0</u>	<u>0,2</u>	<u>11,0</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,406	3,412	3,412	3,412
(*) Datos preliminares				