

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

	19 Diciembre	20 Diciembre	21 Diciembre	22 Diciembre	23 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-2208,0	-2226,7	-2503,2	-2903,4	-2666,5
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	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	8 096,3	8 096,3	8 096,3	8 096,3	7 676,3
Próximo vencimiento de CDBCRP (23 de diciembre de 2005)					430,0
Vencimientos de CDBCRP del 21 de diciembre de 2005					0,0
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>	2 555,0 80,0	2 590,0	2 690,0 50,0 170,0 50,0	3 267,0 17,0	2 890,0 30,0
Propuestas recibidas	2 754,5 80,0	2 665,5	2 874,6 140,0 250,0 50,0	3 267,0 17,0	3 003,0 42,0
Plazo de vencimiento	1 día 1 día	1 día	1 día 1 día 1 día 1 día	1 día 1 día	3 días 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,31/3,47/3,35 3,30/3,30/3,30	3,28/3,45/3,33	3,26/3,38/3,31 3,31/3,37/3,35 3,26/3,35/3,32 3,31/3,31/3,31	3,25/3,39/3,31 3,25/3,25/3,25	3,25/3,36/3,28 3,31/3,31/3,31
Saldo	2 635,0	2 590,0	2 960,0	3 284,0	2 920,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>					
Propuestas recibidas	100,0	100,0		50,0	50,0
Plazo de vencimiento	206,0	206,0		100,0	50,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 año	1 año		6 meses 1 año	1 año
Saldo	4,59/4,60/4,60	4,62/4,62/4,62	851,6	0,51/0,51/0,51 4,74/4,74/4,74	4,74/4,74/4,74
Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 marzo de 2006)	821,6	851,6		951,6	1001,6
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>	0,0	32,7	218,2	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>		9,5	63,5		
Tipo de cambio promedio		3,4399	3,4369		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	327,0	230,7	238,6	280,6	203,5
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%	0,0044%	0,0044%	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%	4,00%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés					
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	75,0	3,0	5,9	0,0	25,4
Tasa de interés	2,50%	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	252,0	227,7	232,7	280,6	178,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 388,0	1 379,1	1 371,3	1 366,4	1 357,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5	7,4	7,4	7,4	7,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	405,4	396,5	388,7	383,8	374,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,1	2,1	2,1	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	34,8	110,7	79,8	162,1	359,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,40/3,45/3,44	3,25/3,40/3,34	3,31/3,45/3,39	3,35/3,45/3,37	3,25/3,45/3,34
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	17,5	22,5	0,0	20,0	21,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,98/4,25/4,21	4,25/4,25/4,25		4,20/4,20/4,20	4,20/4,25/4,20
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	9,0	21,0	12,0	36,5	22,0
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\$)	16 Diciembre	19 Diciembre	20 Diciembre	21 Diciembre	22 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	19,3	-17,8	-15,4	12,6	-21,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	99,5	-8,8	-30,7	80,5	5,0
a. <u>Mercado spot con el público</u>	21,2	-8,6	-50,3	14,0	-14,5
i. Compras	107,6	107,3	109,9	94,3	118,2
ii. (-) Ventas	86,4	115,9	160,2	80,3	132,7
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-58,4	-40,4	4,2	-1,4	5,9
i. Pactadas	1,6	20,0	22,6	10,1	12,6
ii. (-) Vencidas	60,0	60,4	18,5	11,5	6,7
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	21,7	-31,4	-11,1	66,5	32,2
i. Pactadas	76,9	35,4	25,6	68,8	42,6
ii. (-) Vencidas	55,2	66,7	36,7	2,3	10,5
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	61,0	61,0	64,5	50,0	96,8
ii. A futuro	18,0	24,0	5,0	15,0	12,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	15,0	-0,1	12,9	-5,3	0,0
i. Compras	25,0	58,7	29,0	0,6	5,0
ii. (-) Ventas	10,0	58,8	16,1	5,8	5,0
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	58,5	6,3	25,0	62,5	23,3
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,440	3,439	3,438	3,438	3,418
(*) Datos preliminares					