

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

	12 Noviembre	13 Noviembre	14 Noviembre	15 Noviembre	16 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	3 679,5	3 320,4	2 677,7	2 315,4	2 450,5
2. 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	-- 50,0 50,0 100,0 50,0 30,0 2 942,3	30,0 30,0 100,0 50,0 30,0 3035,0 149,1	-- 30,0 30,0 220,0 2098,1	70,0 220,0 1470,3	60,0 20,0 1920,1
Plazo de vencimiento	-- 115,0 107,0 154,0 112,0 115,0 2 942,3	92,0 79,0 139,0 100,0 90,0 3179,1 169,1	-- 55,0 54,0 560,0 2098,1	158,0 382,0 1470,3	149,6 97,0 2199,0
Plazo de vencimiento	2 a. 1 a. 9 m. 6 m. 3 m. 1 m. 1 d.	1 a. 9 m. 6 m. 3 m. 1 m. 1 d. 1 d.	2 a. 1 a. 9 m. 1 m. 1 d.	9 m. 3 m. 1 d.	1 a. 6 m. 3 d.
Tasas de interés: Mínima	-- 5,87 5,76 5,68 5,40 5,13 4,90	5,83 5,76 5,70 5,46 5,13 4,94 5,02	-- 5,86 5,77 5,13 4,87	5,77 5,44 4,90	5,88 5,73 4,96
Tasas de interés: Máxima	-- 5,89 5,80 5,74 5,44 5,13 5,02	5,87 5,78 5,78 5,50 5,13 5,02 5,02	-- 5,89 5,81 5,13 5,02	5,83 5,49 5,02	5,91 5,80 5,02
Tasas de interés: Promedio	-- 5,88 5,79 5,71 5,42 5,13 4,99	5,86 5,77 5,75 5,48 5,13 4,99 5,02	-- 5,88 5,79 5,13 4,99	5,81 5,47 4,99	5,89 5,75 5,00
Saldo	20 928,0	21 409,8	20 603,8	20 266,0	20 795,8
Próximo vencimiento de CDBCRP (23 de noviembre del 2007)					1 920,1
Vencimientos de CDBCRP del 14 al 16 de noviembre del 2007					2 896,1
ii. Subasta de compra temporal de valores					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	500,0		500,0	500,0	0,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (16 de noviembre del 2007)	500,0		500,0		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	41,9	493,9	30,0	3,0	3,0
i. Compras (millones de US\$)	14,0	165,0	10,0	1,0	1,0
Tipo de cambio promedio	2,9926	2,9931	2,9957	2,9950	2,9980
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	499,1	390,2	329,6	558,1	453,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0051%	0,0051%	0,0051%	0,0051%	0,0062%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	200,0	200,0
Tasa de interés	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%	5,58,10%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	499,1	390,2	329,6	558,1	253,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 254,9	2 225,8	2 196,6	2 149,3	2 123,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,5	7,3	7,3	7,1	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	768,0	739,0	709,7	662,4	636,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,4	2,3	2,2	2,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	79,5	15,5	54,5	21,5	231,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,90/5,00/4,93	4,95/4,95/4,95	4,95/5,00/4,97	4,95/5,00/4,99	5,00/5,00/5,00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	5,0	5,0	0,0	0,0	1,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	7,00/7,00/7,00	7,00/7,00/7,00			6,50/6,50/6,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP	39,8	73,0	124,6	254,1	173,2
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	5,0/5,67	57,0/5,68	10,0/5,73	68,0/5,64	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		3,0/5,89	7,0/5,91	19,0/5,82	15,0/5,78
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	9 Noviembre	12 Noviembre	13 Noviembre	14 Noviembre	15 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-41,1	52,7	-113,4	95,5	11,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-85,7	44,1	1,7	96,7	-35,1
a. Mercado spot con el público	43,6	83,4	149,3	124,4	-40,1
i. Compras	196,2	155,6	254,6	237,1	127,7
ii. (-) Ventas	152,6	72,1	105,3	112,7	167,8
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	25,2	34,2	-63,8	102,4	-46,6
i. Pactadas	108,4	39,0	72,5	174,6	130,5
ii. (-) Vencidas	83,3	4,8	136,3	72,2	177,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-19,5	25,6	51,3	103,7	-92,9
i. Pactadas	58,8	47,6	86,2	170,8	77,1
ii. (-) Vencidas	78,2	22,0	35,0	67,1	170,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	140,7	85,3	69,0	148,1	132,5
ii. A futuro	18,0	5,0	15,0	3,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	8,7	-4,0	-96,9	-21,6	2,4
i. Compras	45,5	0,0	21,1	44,0	142,9
ii. (-) Ventas	36,8	4,0	118,0	65,6	140,5
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-143,0	-18,2	-152,0	-11,2	-4,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,994	2,993	2,993	2,997	2,995
(*) Datos preliminares					