

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

	09 Diciembre	10 Diciembre	11 Diciembre	12 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 403,7	2 799,9	2 184,1	2 154,4
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)				
Saldo	--	--	--	--
Próximo vencimiento de CDBCRP (05 de enero del 2008)	7 721,4	7 721,4	7 721,4	7 721,4
Vencimientos de CDBCRP del 11 al 12 de diciembre del 2008			0,0	3 379,1
				0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	1 500,0	500,0	100,0	350,0
Propuestas recibidas	2 730,0	610,0	120,0	585,0
Plazo de vencimiento	1 s.	1 d.	1 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	6,60	6,57	6,50	6,54
Máxima	6,62	6,59	6,60	6,62
Promedio	6,62	6,57	6,54	6,56
Saldo	6 159,1	5 759,1	5 809,1	5 859,1
Próximo vencimiento de Repo (11 diciembre del 2008)				400,0
Vencimientos de Repo del 11 al 12 de diciembre del 2008				2 970,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)	--	--	--	--
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2 915,0	2 915,0	2 915,0	2 915,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (07 de enero del 2009)				465,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	--	--	--	--
Saldo	283,0	283,0	283,0	283,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)	--	--	--	--
Saldo	7 605,1	7 605,1	7 605,1	7 605,1
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (19 de Diciembre de 2008)				1 122,0
Vencimientos de CDBCRP del 11 al 12 de diciembre del 2008				1 122,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera	20,0	15,0		
Propuestas recibidas	20,0	15,0		
Plazo de vencimiento	1 d.	1d.		
Tasas de interés: Mínima	6,80	6,50		
Máxima	6,80	6,50		
Promedio	6,80	6,50		
Saldo				
Próximo vencimiento de Repo (11 diciembre del 2008)				
Vencimientos de Repo del 11 al 12 de diciembre del 2008				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
c. Operaciones con el Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público				
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 423,7	2 914,9	2 534,1	2 554,4
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)	0,0177%	0,0177%	0,0178%	0,0188%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	87,0	67,7	70,2	38,0
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 336,7	2 847,2	2 463,9	2 516,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	5 378,4	5 303,1	5 206,7	5 130,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	12,9	12,6	12,4	12,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 599,8	3 524,6	3 428,2	3 352,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,6	8,4	8,1	7,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	330,0	443,9	415,0	496,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,50/6,55/6,50	6,45/6,55/6,50	6,50/6,50/6,50	6,50/6,59/6,51
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	7,4	0,9	1,6	2,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,10/0,10/0,10	1,00/1,00/1,00	0,10/0,50/0,27	0,10/0,10/0,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	15,0	0,0	44,5	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			26,6/6,93	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	05 Diciembre	09 Diciembre	10 Diciembre	11 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-8,6	-36,7	-18,9	-10,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	122,1	-89,4	-7,2	-58,9
a. Mercado spot con el público	56,9	-33,9	-0,4	-54,2
i. Compras	291,3	213,1	219,4	212,4
ii. (-) Ventas	234,4	246,9	219,8	266,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-44,5	13,2	24,6	-101,6
i. Pactadas	29,5	149,9	101,0	97,2
ii. (-) Vencidas	74,0	136,7	76,4	198,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	86,3	-39,5	36,3	-150,2
i. Pactadas	171,8	131,2	91,6	280,8
ii. (-) Vencidas	85,6	170,7	55,3	431,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	146,5	200,4	124,9	291,4
ii. A futuro	25,0	23,0	0,0	56,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	6,8	-19,6	-30,9	237,5
i. Compras	78,5	74,2	43,6	425,8
ii. (-) Ventas	71,8	93,8	74,5	188,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	70,0	-2,0	3,0	-10,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1202	3,1167	3,1143	3,1070
(*) Datos preliminares				