

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	28 Diciembre	29 Diciembre	30 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 733,3	2 136,7	2 369,6
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)	1 199,9	1 555,3	1 091,2
Propuestas recibidas	1 345,6	1 555,3	1 091,2
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	5 d.
Tasas de interés: Mínima	1,09	1,05	1,01
Máxima	1,20	1,23	1,25
Promedio	1,13	1,11	1,17
Saldo	14 229,4	14 584,8	14 120,7
Próximo vencimiento de CD BCRP (4 de enero del 2010)			1 091,2
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 8 de enero del 2010			1 091,2
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)			
Saldo	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR BCRP)			
Saldo	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Saldo	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)			
Saldo	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera			
Saldo	299,5	299,5	299,5
Próximo vencimiento de Repo (25 de enero del 2010)			39,8
Vencimientos de CD BCRP del 4 al 8 de enero del 2010			0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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 (millones de US\$)	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
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	549,8	608,4	1 287,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0053%	0,0052%	0,0052%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés	2,05%	2,05%	2,05%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	273,0	327,5	784,2
Tasa de interés	0,45%	0,45%	0,45%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	276,8	280,9	502,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 336,0	3 302,3	3 278,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,2	7,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 259,8	1 226,1	1 201,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,7	2,7	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	630,7	436,7	301,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,20/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,20/1,25/1,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	67,0	29,0	198,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,15/0,20/0,17	0,15/0,15/0,15	0,15/0,35/0,33
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	482,0	1 165,7	2 050,1
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\$)	24 Diciembre	28 Diciembre	29 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	17,1	5,3	-113,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	14,3	-275,1	-114,7
a. Mercado spot con el público	13,5	-228,8	-24,1
i. Compras	43,5	254,5	219,5
ii. (-) Ventas	29,9	483,3	243,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-1,5	-119,7	-33,3
i. Pactadas	0,0	188,6	272,2
ii. (-) Vencidas	1,5	308,3	305,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-4,2	-400,2	-34,2
i. Pactadas	0,0	43,5	113,7
ii. (-) Vencidas	4,2	443,7	147,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	0,0	251,3	288,8
ii. A futuro	0,0	0,0	35,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	3,6	102,1	-178,1
i. Compras	3,6	388,8	114,1
ii. (-) Ventas	0,0	286,7	292,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	-13,0	-70,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		2,8835	2,8865
(*) Datos preliminares			