

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

	12 Enero	13 Enero	14 Enero	15 Enero	16 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 391,6	950,2	695,2	-240,5	-411,5
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>					
Saldo	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (09 de febrero del 2009)					470,0
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 23 de enero del 2009					0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>	<u>1 050,0</u>	<u>900,0</u>	<u>400,0</u>	<u>500,0</u>	<u>1 300,0</u>
Propuestas recibidas	1 050,0	945,0	580,0	600,0	1 335,0
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	3 d.
Tasas de interés: Mínima	6,50	6,58	6,57	6,55	6,57
Máxima	6,53	6,58	6,62	6,55	6,59
Promedio	6,53	6,58	6,58	6,55	6,57
Saldo	2 539,1	1 989,1	1 989,1	2 239,1	2 389,1
Próximo vencimiento de Repo (19 enero del 2009)					1 300,0
Vencimientos de Repo del 19 al 23 de enero del 2009					1 300,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)</u>		60,0	60,0		
Propuestas recibidas	-,-	360,0	360,0	-,-	-,-
Plazo de vencimiento	3 m.	3 m.	3 m.	6 m.	
Tasas de interés: Mínima	-,-	1,59	1,58	-,-	-,-
Máxima	-,-	1,59	1,58	-,-	-,-
Promedio	-,-	1,59	1,58	-,-	-,-
Saldo	4 360,0	4 420,0	4 480,0	4 270,0	4 190,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (21 de enero del 2009)					555,0
Vencimientos de CDR BCRP del 19 al 23 de enero del 2009					855,00
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</u>					
Saldo	6 483,1	6 483,1	6 483,1	6 483,1	6 483,1
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (09 de Febrero del 2009)					957,0
Vencimientos de CDBCRP del 19 al 23 de enero del 2009					0,0
vi. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>		<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Saldo	0,0	0,0		0,0	0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>		12,0	213,5	3,0	1,0
Tipo de cambio promedio		3,1503	3,1511	3,1510	3,1510
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	<u>-16,7</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>	16,7				
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>					
ii. <u>Compras de BTP</u>					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 441,6	1 828,0	862,4	900,0	885,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0176%	0,0175%	0,0175%	0,0175%	0,0175%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>104,6</u>	<u>935,0</u>	<u>520,0</u>	<u>310,0</u>	<u>199,1</u>
Tasa de interés	5,75%	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	2 337,0	893,0	342,4	590,0	686,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	4 094,7	3 985,3	3 852,1	3 753,2	3 672,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,7	9,4	9,1	8,8	8,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 316,2	2 206,7	2 073,5	1 974,6	1 894,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,2	4,9	4,6	4,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>494,5</u>	<u>674,5</u>	<u>772,0</u>	<u>688,5</u>	<u>600,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,45/6,50/6,50	6,45/6,50/6,50	6,50/6,60/6,52	6,45/6,55/6,51	6,50/6,55/6,50
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>6,8</u>	<u>1,5</u>	<u>9,4</u>	<u>8,4</u>	<u>5,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,09/0,10/0,10	0,10/0,10/0,10	0,10/0,30/0,25	0,20/0,20/0,20	0,20/0,20/0,20
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u>	<u>40,0</u>	<u>72,0</u>	<u>73,0</u>	<u>70,0</u>	<u>22,0</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\$)	09 enero	12 enero	13 enero	14 enero	15 enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-50,3	-6,3	80,6	171,4	-105,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-4,3	13,9	-13,3	294,6	-107,3
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>-8,1</u>	<u>2,8</u>	<u>-42,4</u>	<u>74,2</u>	<u>-39,9</u>
i. <u>Compras</u>	190,4	187,1	187,4	326,9	220,3
ii. <u>(-) Ventas</u>	198,5	184,2	229,7	252,6	260,2
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-45,5</u>	<u>26,5</u>	<u>108,3</u>	<u>-39,6</u>	<u>-156,1</u>
i. <u>Pactadas</u>	112,4	46,5	222,9	49,2	41,3
ii. <u>(-) Vencidas</u>	157,9	20,0	114,6	88,8	197,4
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>0,6</u>	<u>46,6</u>	<u>14,3</u>	<u>83,6</u>	<u>-157,9</u>
i. <u>Pactadas</u>	116,7	84,4	177,2	146,7	132,8
ii. <u>(-) Vencidas</u>	116,2	37,8	162,9	63,1	290,7
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u>Al contado</u>	268,7	237,4	291,1	202,3	188,0
ii. <u>A futuro</u>	23,0	22,0	38,4	44,8	25,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-39,9</u>	<u>12,8</u>	<u>48,2</u>	<u>-28,9</u>	<u>94,3</u>
i. <u>Compras</u>	116,0	31,3	162,7	58,0	289,5
ii. <u>(-) Ventas</u>	155,8	18,5	114,5	86,8	195,2
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>2,0</u>	<u>16,0</u>	<u>29,1</u>	<u>223,5</u>	<u>-68,4</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1348	3,1416	3,1489	3,1514	3,1492
(*) Datos preliminares					