

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

| | 15 Enero | 16 Enero | 17 Enero | 18 Enero | 19 Enero |
|--|--|---|--|--|--|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 440.6 | 683.8 | 704.1 | 412.7 | 499.6 |
| 2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones | | | | | |
| a. Operaciones monetarias anuenciadas del BCR | | | | | |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 50.0 130.0 50.0 | 100.0 100.0 150.0 250.0 200.0 55.0 | 70.0 100.0 150.0 70.0 150.0 | 50.0 164.0 73.5 | 30.0 45.0 73.0 300.0 100.0 |
| Plazo de vencimiento | 164.0 224.0 79.5 | 266.0 185.6 359.5 293.0 253.0 55.0 | 209.0 182.0 251.6 70.0 180.0 | 106.0 230.0 121.5 | 61.0 45.0 73.0 568.5 161.5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4.48/4.53/4.52 4.34/4.38/4.37 4.41/4.41/4.41 | 5.47/5.55/5.50 5.17/5.25/5.20 4.90/4.95/4.94 4.50/4.50/4.50 4.38/4.38/4.38 4.41/4.53/4.48 | 5.76/5.85/5.79 5.22/5.25/5.25 4.92/5.00/4.96 4.75/4.92/4.87 4.66/4.66/4.56 | 5.51/5.58/5.54 4.54/4.59/4.58 4.49/4.53/4.51 | 5.81/5.89/5.83 5.25/5.31/5.29 4.88/5.05/4.94 4.30/4.35/4.34 4.19/4.25/4.19 |
| Saldo | 10 229.5 | 10 353.5 | 10 293.5 | 10 235.9 | 10 555.4 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (17 de enero de 2007) | | | | | 450.0 |
| Vencimientos de CDBCRP del 17 al 19 de enero de 2007 | | | | | 1 014.0 |
| 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 Rescatable del BCR (CDBRCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de CDBRCRP | | | | | |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 31.0 | 207.3 | 127.5 | 223.1 | 318.8 |
| i. Compras (millones de US\$) | 10.0 | 65.0 | 40.0 | 70.0 | 100.0 |
| Tipo de cambio promedio | 3,1909 | 3,1889 | 3,1884 | 3,1875 | 3,1885 |
| 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 | | 50.0 | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 142.6 | 136.1 | 261.7 | 328.3 | 250.5 |
| 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) | 0,0068% | 0,0068% | 0,0068% | 0,0068% | 0,0079% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% |
| d. Depósitos overnight en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 3,75% | 3,75% | 3,75% | 3,75% | 3,75% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 116.4 | 107.2 | 243.0 | 328.3 | 203.5 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 1 920.3 | 1 900.1 | 1 890.3 | 1 886.3 | 1 876.2 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 8.4 | 8.3 | 8.3 | 8.3 | 8.2 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 430.0 | 409.8 | 400.0 | 386.0 | 385.9 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1.9 | 1.8 | 1.8 | 1.7 | 1.7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 145.0 | 193.0 | 638.8 | 593.4 | 440.5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4.30/4.50/4.42 | 4.30/4.50/4.42 | 4.40/4.55/4.50 | 4.40/4.65/4.53 | 4.30/4.55/4.47 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 10.0 | 10.0 | 5.0 | 5.0 | 25.0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5.50/5.50/5.50 | 5.50/5.50/5.50 | 5.50/5.50/5.50 | 5.50/5.50/5.50 | 5.50/5.50/5.50 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 14.0 | 33.0 | 71.2 | 148.7 | 18.0 |
| 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\$) | 12 Enero | 15 Enero | 16 Enero | 17 Enero | 18 Enero |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 1.3 | 29.6 | -21.8 | 28.0 | 25.1 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | -19.2 | 13.6 | -37.8 | 13.7 | -36.1 |
| a. Mercado spot con el público | 40.8 | 25.0 | 21.7 | 50.1 | 35.4 |
| i. Compras | 153.3 | 100.2 | 101.2 | 166.0 | 168.0 |
| ii. (-) Ventas | 112.4 | 75.2 | 79.5 | 116.0 | 132.6 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 41.2 | 38.2 | 28.9 | 31.9 | -128.1 |
| i. Pactadas | 59.0 | 41.2 | 115.7 | 156.7 | 99.6 |
| ii. (-) Vencidas | 17.8 | 5.0 | 38.8 | 124.8 | 227.7 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 20.7 | 20.2 | 60.9 | 17.6 | -189.3 |
| i. Pactadas | 25.4 | 25.4 | 111.9 | 111.9 | 2.0 |
| ii. (-) Vencidas | 5.7 | 2.7 | 50.9 | 112.2 | 191.3 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 43.0 | 29.0 | 82.5 | 59.0 | 128.5 |
| ii. A futuro | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 15.0 | 35.0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -12.2 | -2.8 | 9.0 | -13.3 | -11.3 |
| i. Compras | 1.3 | 0.1 | 43.0 | 109.0 | 185.7 |
| ii. (-) Ventas | 13.5 | 3.9 | 34.0 | 122.5 | 227.0 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -60.0 | -10.0 | -56.5 | -36.5 | -66.5 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat) | 3,190 | 3,191 | 3,189 | 3,188 | 3,188 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |