

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

| | 12 Febrero | 13 Febrero | 14 Febrero | 15 Febrero | 16 Febrero |
|--|---|--|--|---|--|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 988.5 | 832.5 | 417.2 | 923.5 | 644.2 |
| 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 | 70.0 50.0 100.0 115.0 150.0 80.0 | 80.0 50.0 100.0 200.0 100.0 | 100.0 24.0 40.0 | 100.0 150.0 101.0 120.0 150.0 110.0 | 100.0 100.0 17.0 184.0 100.0 |
| Plazo de vencimiento | 2 años 18 meses 6 meses 1 semana 1 día 1 día | 3 años 18 meses 1 año 1 semana 1 día | 2 años 1 semana 1 día | 3 años 1 año 3 meses 1 semana 1 día 1 día | 2 años 1 año 3 meses 1 semana 1 día |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5.58/5.63/5.62 5.40/5.43/5.42 4.92/4.92/4.92 4.53/4.56/4.53 4.30/4.41/4.34 4.26/4.30/4.28 | 5.91/5.95/5.93 5.42/5.48/5.44 5.20/5.28/5.25 4.52/4.52/4.52 4.30/4.34/4.31 | 5.61/5.66/5.64 4.55/4.59/4.56 4.49/4.49/4.49 | 5.90/5.93/5.92 5.23/5.23/5.23 4.81/4.95/4.88 4.56/4.55/4.55 4.26/4.45/4.37 4.34/4.41/4.38 | 5.61/5.63/5.62 5.25/5.25/5.25 4.91/4.95/4.94 4.58/4.60/4.59 4.38/4.40/4.38 |
| Saldo | 11 374.3 | 11 384.4 | 11 308.4 | 11 385.4 | 11 586.4 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (14 de febrero del 2007) | | | | | 215.0 |
| Saldo | | | | | 569.0 |
| ii. Subasta de compra temporal de valores | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de CDBCRP | 0.0 | | | | |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de CDRBCRP | | | | | |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) | 0.0 | 0.0 | 79.7 | 159.4 | 255.0 |
| Tipo de cambio promedio | | | 25.0 | 80.0 | 80.0 |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | 3,189.0 | 3,188.0 | 3,187.0 |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| c. Operaciones con el Tesoro Público | | | | | |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | | | 15.0 | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 424.5 | 312.5 | 353.0 | 351.9 | 418.2 |
| 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) | 0,0047% | 0,0048% | 0,0048% | 0,0049% | 0,0058% |
| 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 | | | | | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 1 756,4 | 1 747,1 | 1 735,0 | 1 729,6 | 1 722,5 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,3 | 7,2 | 7,2 | 7,1 | 7,1 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 438,5 | 427,2 | 416,2 | 409,7 | 402,6 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1,8 | 1,8 | 1,7 | 1,7 | 1,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 220,2 | 424,7 | 661,5 | 446,7 | 419,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,40/4,50/4,45 | 4,45/4,50/4,46 | 4,45/4,55/4,49 | 4,45/4,50/4,48 | 4,45/4,55/4,50 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 13,0 | 9,5 | 8,0 | 29,0 | 6,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5,55/5,55/5,55 | 5,55/5,55/5,55 | 5,55/5,55/5,55 | 5,55/5,55/5,55 | 5,55/5,55/5,55 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 233,2 | 434,2 | 669,5 | 475,7 | 425,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 16,0 | 16,0 | 18,0 | 18,0 | 18,0 |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | 7,0/5,10 | 2,0/5,15 | 2,0/5,15 | | 6,0/4,92 |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | | | | | |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 73,1 | 43,2 | -22,0 | -23,7 | -37,3 |
| Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + f | 72,0 | 10,4 | -47,0 | -47,0 | -8,1 |
| a. Mercado spot con el público | 54,5 | 8,1 | -9,8 | -22,6 | 50,4 |
| i. Compras | 193,3 | 103,3 | 78,2 | 80,9 | 148,7 |
| ii. (-) Ventas | 138,8 | 95,2 | 88,0 | 103,5 | 98,2 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 21,0 | 6,3 | 25,3 | 33,3 | -54,7 |
| i. Pactadas | 60,8 | 70,1 | 41,3 | 156,4 | 79,5 |
| ii. (-) Vencidas | 39,9 | 63,9 | 16,0 | 123,1 | 134,1 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 19,8 | -28,6 | 0,3 | 10,0 | -100,0 |
| i. Pactadas | 35,7 | 17,5 | 44,6 | 59,7 | 6,2 |
| ii. (-) Vencidas | 15,8 | 44,1 | 44,3 | 49,8 | 106,2 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 99,5 | 94,3 | 66,0 | 124,0 | 154,0 |
| ii. A futuro | 30,0 | 5,0 | 16,0 | 20,0 | 40,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -24,8 | -22,2 | -9,4 | -21,8 | -25,1 |
| i. Compras | 15,2 | 40,8 | 5,6 | 41,0 | 95,0 |
| ii. (-) Ventas | 39,5 | 63,5 | 15,0 | 112,8 | 130,1 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 7,8 | 5,2 | 0,5 | -28,0 | -51,4 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,192 | 3,193 | 3,191 | 3,189 | 3,188 |