

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

	26 Febrero	27 Febrero	28 Febrero	1 Marzo	2 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	177,1	238,7	238,1	191,8	516,3
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>	100,0	50,0	140,0	80,0	120,0
Propuestas recibidas	273,0	127,0	203,5	149,0	157,5
Plazo de vencimiento	3 años	1 año	1 día	2 años	1 día
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,77/5,83/5,81	5,21/5,26/5,24	4,49/4,53/4,52	5,58/5,63/5,61	4,45/4,45/4,45
Saldo	11 423,4	11 503,4	11 603,4	11 603,4	11 603,4
Próximo vencimiento de CDBCRP (28 de febrero del 2007)				11 463,4	11 169,4
Vencimientos de CDBCRP del 28 de febrero al 2 de marzo del 2007					401,9
ii. <u>Subasta de compra temporal de valores</u>				300,0	200,0
Propuestas recibidas				949,6	395,0
Plazo de vencimiento				1 día	1 día
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				4,63/4,66/4,65	4,56/4,65/4,61
Saldo				500,0	4,63/4,67/4,64
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>					100,0
Propuestas recibidas					410,0
Plazo de vencimiento					3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					100,0
Saldo					401,9
Próximo vencimiento de CDRBCRP					401,9
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	223,1	0,0	0,0	0,0	63,8
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>	70,0				20,0
Tipo de cambio promedio	3,1877				3,1878
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>	106,5	1,5			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	210,2	118,7	98,1	691,8	680,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0058%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	76,5	51,0	23,3	71,1	31,0
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	133,7	67,7	74,8	620,7	649,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 634,4	1 625,2	1 666,3	1 989,9	1 955,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	7,0	7,0	9,7	8,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	314,5	305,4	297,1	620,7	634,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,3	1,3	1,2	3,0	2,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	561,0	576,7	546,8	441,0	413,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,55/4,50	4,45/4,55/4,49	4,45/4,55/4,50	4,50/4,65/4,52	4,45/4,55/4,52
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	10,0	13,0	2,0	15,0	31,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,50/5,50/5,50	5,50/5,50/5,50	5,55/5,55/5,55	5,50/5,55/5,52	5,50/5,55/5,52
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	29,5	103,5	98,7	93,5	112,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		8,5/4,95			5,0/4,89
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				5,0/5,15	15,0/5,08
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	20,0/5,52			2,0/5,52	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 Febrero	26 Febrero	27 Febrero	28 Febrero	1 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	45,8	8,2	-3,2	2,9	-9,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	15,8	-34,6	112,8	52,4	40,7
a. <u>Mercado spot con el público</u>	24,1	-18,4	41,4	57,1	27,8
i. <u>Compras</u>	112,5	109,7	138,2	173,8	114,9
ii. (-) <u>Ventas</u>	88,3	128,1	96,9	116,7	87,1
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	122,2	-66,5	-108,7	-101,3	-54,8
i. <u>Pactadas</u>	147,3	106,1	25,1	113,2	58,2
ii. (-) <u>Vencidas</u>	25,1	172,6	133,8	214,5	113,0
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	92,2	-109,3	7,4	-51,8	-4,4
i. <u>Pactadas</u>	99,3	116,2	83,0	147,6	55,1
ii. (-) <u>Vencidas</u>	7,1	225,4	75,6	199,5	59,5
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u>Al contado</u>	84,5	114,5	85,0	100,5	120,5
ii. <u>A futuro</u>	5,0	14,0	15,0	60,0	10,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-15,8	104,4	-1,0	-23,6	-41,9
i. <u>Compras</u>	3,7	223,2	65,0	184,2	57,0
ii. (-) <u>Ventas</u>	19,5	118,8	66,0	207,8	98,9
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-10,5	-67,7	14,4	3,8	1,3
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,188	3,187	3,189	3,190	3,190