

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

	31 Diciembre	2 Enero	3 Enero	4 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1.377,3	2.033,8	1.906,8	1.650,0
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)	1.158,3	234,0 699,9	8,0 400,0 400,0	100,0 200,0 100,0 1250,0
Propuestas recibidas	1.158,3	234,0 902,8	526,0 712,8 476,0	262,0 382,0 336,0 1399,8
Plazo de vencimiento	2 d.	6 m. 1 d.	3 m. 1 d. 1 d.	1 a. 6 m. 3 m. 3 d.
Tasas de interés: Mínima	4,79	5,82 4,87	5,69 4,87 4,94	5,96 5,86 5,68 4,80
Máxima	5,02	5,94 5,02	5,70 4,90 5,02	6,06 5,89 5,70 5,01
Promedio	4,99	5,88 5,00	5,70 4,90 5,01	6,04 5,89 5,70 4,97
Saldo	21.458,2	20.763,8	20.871,9	21.721,9
Próximo vencimiento de CDBCRP (3 de enero del 2008)				1.250,0
Vencimientos de CDBCRP del 3 al 4 de enero del 2008				2.420,1
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 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	0,0	0,0	341,3	112,8
i. Compras (millones de US\$)			115,0	38,0
Tipo de cambio promedio			2,9681	2,9682
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				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	219,0	1.099,9	1.440,1	n.d
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)	0,0059%	0,0051%	0,0051%	0,0062%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	20,0	20,0	0,0	n.d
Tasa de interés	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	199,0	1.079,9	1.440,1	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2.015,6	2.123,8	2.390,7	2.450,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,4	6,3	7,3	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	531,2	639,5	906,3	679,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,9	2,8	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	337,5	287,5	245,5	441,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,95/5,00/4,99	5,00/5,00/5,00	4,90/5,00/4,99	4,95/5,00/4,99
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	23,5	20,9	20,8	37,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,25/5,50/5,45	5,00/5,50/5,50	5,50/5,75/5,62	5,50/5,75/5,63
c. Total mercado secundario de CDBCRP	74,5	29,0	217,1	n.d
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			158,0/5,85	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		4,0/5,93		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Diciembre	28 Diciembre	31 Diciembre	2 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-26,5	-39,9	32,7	-47,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	26,9	-94,1	-69,3	-85,6
a. Mercado spot con el público	69,8	10,2	69,3	-50,1
i. Compras	246,0	254,9	131,7	109,7
ii. (-) Ventas	176,2	244,7	62,5	159,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-4,5	-28,5	-99,8	106,3
i. Pactadas	94,5	70,1	9,0	163,0
ii. (-) Vencidas	99,0	98,6	108,9	56,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	48,8	-82,7	-201,9	67,8
i. Pactadas	124,9	89,3	8,4	128,2
ii. (-) Vencidas	76,1	172,0	210,2	60,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	216,3	198,2	90,5	202,5
ii. A futuro	36,0	75,0	4,0	32,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-59,8	-11,8	-36,3	-27,8
i. Compras	37,5	85,0	68,9	28,5
ii. (-) Ventas	97,3	96,8	105,1	56,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6,0	-19,0	-1,0	-4,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)				
(*) Datos preliminares	2,989	2,992	2,981	2,969