

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

	14 Enero	15 Enero	16 Enero	17 Enero	18 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 239,6	1 986,7	2 999,7	3 139,4	4 862,7
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	-- 78,0 575,0 596,0 1000,0	-- 131,0 1500,1	11,6 2 000,0	1500,0	--
Plazo de vencimiento	-- 147,0 635,0 602,0 1925,1	-- 291,0 3111,8	359,2 2 729,5	2916,4	
Tasas de interés: Mínima	2 a. 18 m. 1 a. 9 m. 1 d.	2 a. 15 m. 1 d.	15 m. 1 d.	1 d.	
Máxima	-- 6,38 6,10 5,95 4,79	-- 6,39 4,75	6,39 4,49	4,45	
Promedio	-- 6,51 6,41 6,28 4,97	-- 6,52 4,79	6,43 4,87	4,72	
Saldo	-- 6,44 6,32 6,19 4,96	-- 6,46 4,79	6,42 4,79	4,65	
Próximo vencimiento de CDBCRP (16 de ene del 2008)	26 838,9	27 470,0	27 981,5	27 071,4	23 971,4
Vencimientos de CDBCRP del 16 al 18 de enero del 2008				3 100,0	1 600,0
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 Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDRBCRP (16 de noviembre del 2007)					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	1281,5	1406,9	0,0	94,5	
i. Compras (millones de US\$)	437,7	478,7		32,0	
Tipo de cambio promedio	2,9278	2,9390		2,9526	
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	100,0	100,0			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 272,1	1 762,5	988,1	1 733,9	4 862,7
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)	0,0086%	0,0086%	0,0085%	0,0085%	0,0074%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	943,8	1260,9	779,0	1559,7	0,0
Tasa de interés	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	328,3	501,6	209,1	174,2	4 862,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 484,6	2 467,2	2 433,8	2 402,2	2 350,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,9	7,9	7,8	7,7	8,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	761,9	744,6	711,1	679,5	911,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,4	2,3	2,2	3,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	43,0	368,5	309,7	174,9	380,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,93/5,05/5,01	4,90/5,10/5,08	5,00/5,05/5,04	4,85/5,05/4,93	0,10/5,00/3,33
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	44,0	24,5	29,5	55,5	67,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,65/6,25/5,72	5,65/6,05/5,78	5,75/6,05/5,88	5,65/6,55/5,95	5,50/6,55/6,16
c. Total mercado secundario de CDBCRP	705,4	1 761,3	816,1	374,4	210,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	87,9/5,78	6,0/5,75	152,0/5,81	105,0/5,79	68,6/5,77
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	173,5/6,00	667,0/5,98	412,7/6,04	77,6/6,10	80,0/5,90
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	11 Enero	14 Enero	15 Enero	16 Enero	17 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-9,7	54,5	-53,4	192,2	194,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	70,7	-27,9	-29,7	206,4	213,9
a. Mercado spot con el público	388,3	364,4	412,8	190,4	272,8
i. Compras	512,2	478,7	547,7	309,8	399,1
ii. (-) Ventas	123,9	114,3	134,9	119,4	126,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	80,9	-131,1	141,0	94,6	17,2
i. Pactadas	192,7	161,2	224,3	174,8	122,2
ii. (-) Vencidas	111,8	292,3	83,3	80,2	105,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	161,3	-213,5	164,7	108,8	36,5
i. Pactadas	186,4	177,8	207,5	169,5	142,8
ii. (-) Vencidas	25,1	391,3	42,8	60,7	106,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	202,1	146,0	267,3	174,1	163,0
ii. A futuro	20,0	7,0	25,0	3,0	45,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-49,5	126,6	-3,3	-1,0	-8,7
i. Compras	17,0	291,8	42,7	58,0	95,3
ii. (-) Ventas	66,5	165,2	46,0	59,0	104,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-354,8	-419,9	-479,7	-2,5	-49,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,939	2,927	2,938	2,948	2,955
(*) Datos preliminares					