

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

	05 Enero	06 Enero	07 Enero	08 Enero	09 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	220,9	1 856,8	2 909,4	2 647,4	2 716,3
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)					
Saldo	--	--	--	--	--
Próximo vencimiento de CDBCRP (09 de febrero del 2009)	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3
Vencimientos de CDBCRP del 12 al 16 de enero del 2009					470,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	1 500,0	2 000,0	400,0	1 000,0	500,0
Propuestas recibidas	2 440,0	2 148,7	885,0	2 017,0	1 155,0
Plazo de vencimiento	1 s.	1 d.	1 s.	1 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima	6,69	6,50	6,73	6,50	6,55
Máxima	6,73	7,00	6,74	6,61	6,59
Promedio	6,73	6,59	6,73	6,55	6,56
Saldo	4 589,1	3 989,1	3 489,1	3 439,1	3 389,1
Próximo vencimiento de Repo (12 enero del 2009)					1 900,0
Vencimientos de Repo del 12 al 16 de enero del 2009					2 300,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)		--	300,0	--	--
Propuestas recibidas			300,0		
Plazo de vencimiento			3 m.		
Tasas de interés: Mínima			1,78		
Máxima			1,90		
Promedio			1,85		
Saldo	4 525,0	4 525,0	4 360,0	4 360,0	4 360,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (15 de enero del 2009)			210,00		210,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	--	--	--	--	--
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)	--	--	--	--	--
Saldo	6 483,1	6 483,1	6 483,1	6 483,1	6 483,1
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (09 de Febrero del 2009)					957,0
Vencimientos de CDBCRP del 12 al 16 de enero del 2009					0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera		0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo		0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	-66,0		
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)				21,0	
Tipo de cambio promedio				3,1422	
c. Operaciones con el Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3 620,9	3 256,8	3 043,4	3 097,4	3 116,3
4. Operación					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0176%	0,0176%	0,0176%	0,0176%	0,0187%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	20,0	199,0	20,0	12,0	145,5
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3 600,9	3 057,8	3 023,4	3 085,4	2 970,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 254,2	3 517,9	3 701,3	3 846,6	3 946,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,1	8,6	9,0	9,3	9,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 475,6	1 739,3	1 922,8	2 068,1	2 168,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,7	4,3	4,7	5,0	5,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	467,0	573,0	366,9	371,3	469,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,50/7,05/6,51	6,50/6,55/6,50	6,50/6,65/6,50	6,50/6,50/6,50	6,45/6,50/6,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	20,1	72,0	83,0	189,1	194,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,05/0,65/0,38	0,50/0,50/0,50	0,16/0,50/0,47	0,50/0,50/0,50	0,50/0,50/0,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	6,0	114,5	171,0	110,0	86,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		2,0/7,10			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	2,0/7,25		5,0/6,58		67,6/6,55
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	02 enero	05 enero	06 enero	07 enero	08 enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	23,7	-38,8	26,1	13,4	-73,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-5,9	-196,8	-125,7	24,6	-75,4
a. Mercado spot con el público	-6,9	-144,6	-60,9	96,3	-69,4
i. Compras	79,0	216,7	241,5	299,4	237,9
ii. (-) Ventas	85,9	361,3	302,3	203,1	307,4
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-1,5	-80,0	92,3	61,2	-6,6
i. Pactadas	0,0	105,9	153,4	213,2	141,9
ii. (-) Vencidas	1,5	185,9	61,1	152,1	148,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-31,1	-238,0	-59,5	72,4	-8,5
i. Pactadas	0,0	59,1	54,9	311,7	147,9
ii. (-) Vencidas	31,1	297,1	114,4	239,3	156,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0,0	264,2	469,3	276,7	212,0
ii. A futuro	0,0	40,0	61,0	70,0	64,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	30,6	23,1	-5,6	45,0	7,9
i. Compras	31,0	165,8	55,0	196,5	155,9
ii. (-) Ventas	0,4	142,7	60,6	151,5	148,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	35,9	-6,0	-29,5	-6,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1408	3,1397	3,1316	3,1415	3,1416
(*) Datos preliminares					

d. = día(s)

s. = semana(s)

m. = mes(es)

a. = año(s)