

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

	19 Enero	20 Enero	21 Enero	22 Enero	23 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-477,6	-830,2	-978,6	-1 432,2	-1 903,7
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)					
Saldo	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (09 de febrero del 2009)					470,0
Vencimientos de CD BCRP del 26 al 30 de enero del 2009					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	1 300,0	1 650,0	1 960,1	2 200,0	2 700,0
Propuestas recibidas	1 342,0	1 750,0	2 300,0	2 510,0	2 723,0
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.	1 d.	1 d.	3 d.
Tasas de interés: Mínima	6,57	6,57	6,57	6,61	6,64
Máxima	6,59	6,65	6,61	6,65	6,67
Promedio	6,57	6,58	6,58	6,62	6,66
Saldo	2 389,1	2 739,1	3 049,2	3 289,1	3 789,1
Próximo vencimiento de Repo (26 enero del 2009)					2 700,0
Vencimientos de Repo del 26 al 30 de enero del 2009					3 400,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)	100,1 100,0	300,0	400,0 160,0	300,0 100,0	80
Propuestas recibidas	232,0 177,2	360,0	575,0 160,0	405,0 115,0	110,0
Plazo de vencimiento	3 m. 3 m.	3 m.	3 m. 3 m.	3 m. 3 m.	4 m.
Tasas de interés: Mínima	1,62 1,62	1,61	1,61 1,61	1,61 1,50	1,78
Máxima	1,63 1,62	1,62	1,61 1,63	1,61 1,60	1,83
Promedio	1,63 1,62	1,62	1,61 1,61	1,61 1,56	1,81
Saldo	4 390,1	4 690,1	4 695,1	4 795,1	4 875,1
Próximo vencimiento de CDRBCRP (26 de enero del 2009)					0,0
Vencimientos de CDR BCRP del 26 al 30 de enero del 2009					0,0
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		957,0
Vencimientos de CDBCRP del 26 al 30 de enero del 2009			0		0,0
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera					
Saldo		0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	-72,6	-227,2	0,0	0,0	-284,6
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	23,0	72,0			90,0
Tipo de cambio promedio	3,1560	3,1559			3,1623
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	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	549,7	292,6	421,5	367,8	431,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0175%	0,0175%	0,0175%	0,0175%	0,0185%
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	209,5	17,0	21,0	46,0	21,0
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	340,2	275,6	400,5	321,8	410,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 463,7	3 393,2	3 335,4	3 279,3	3 231,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,1	7,9	7,8	7,7	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 685,2	1 614,7	1 556,9	1 500,7	1 453,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,9	3,8	3,6	3,5	3,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	570,8	594,5	765,0	552,6	578,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,50/6,55/6,50	6,50/6,70/6,53	6,50/6,70/6,53	6,50/6,65/6,53	6,55/6,67/6,56
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	5,9	15,5	11,0	5,6	2,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,17/0,20/0,18	0,20/0,20/0,20	0,20/0,40/0,28	0,30/0,30/0,30	0,40/0,40/0,40
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	9,0	0,0	4,0	27,0	15,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	16 enero	16 enero	20 enero	21 enero	22 enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	8,3	8,3	33,5	5,7	0,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	32,5	32,5	55,8	-29,6	21,1
a. Mercado spot con el público.	34,7	34,7	-97,0	-26,6	-15,1
i. Compras	275,3	275,3	228,5	183,8	212,6
ii. (-) Ventas	240,6	240,6	325,4	210,4	227,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	10,0	10,0	-14,0	74,8	-42,0
i. Pactadas	26,9	26,9	119,6	117,0	90,7
ii. (-) Vencidas	17,0	17,0	133,6	42,2	132,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	34,2	34,2	8,3	39,5	-21,7
i. Pactadas	47,9	47,9	131,0	54,0	129,3
ii. (-) Vencidas	13,6	13,6	122,7	14,5	151,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	179,4	179,4	228,1	181,9	292,5
ii. A futuro	24,5	24,5	15,9	60,0	30,2
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	10,5	10,5	-19,1	-27,4	18,3
i. Compras	13,5	13,5	113,1	13,0	150,6
ii. (-) Ventas	3,0	3,0	132,2	40,4	132,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-16,1	-16,1	161,0	-3,3	36,1
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1455	3,1455	3,1578	3,1524	3,1548
(*) Datos preliminares					