

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)**

| | 15 Febrero | 16 Febrero | 17 Febrero | 18 Febrero | 19 Febrero |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 2 141,9 | 2 133,7 | 2 075,0 | 1 874,8 | 1 673,3 |
| 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) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 999,9 | 300,0 | 950,0 | 1 262,7 | 150,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 333,3 | 799,5 | 1 058,2 | 1 262,7 | 206,0 |
| Tasas de interés | 1,20 | 1,25 | 1,20 | 1,20 | 1,30 |
| Máxima | 1,23 | 1,29 | 1,23 | 1,23 | 1,30 |
| Promedio | 1,21 | 1,28 | 1,22 | 1,22 | 1,30 |
| Saldo | | 20 502,1 | | 20 264,9 | |
| Próximo vencimiento de CD BCRP (22 de febrero del 2010) | | | | 19 894,5 | |
| Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de febrero del 2010 | | | | 1 350,2 | 1 200,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | | | | 1 350,2 | 1 200,0 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDR BCRP) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| vi. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera | | | | | |
| Saldo | 259,7 | 259,7 | 259,7 | 259,7 | 259,7 |
| Próximo vencimiento de Repo (16 de agosto del 2010) | | | | 50,0 | 50,0 |
| Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de febrero del 2010 | | | | 0,0 | 0,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| iii. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$) | | | | | |
| Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | |
| Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | |
| iv. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| v. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | | |
| vi. Compras de BTP | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 609,4 | 486,4 | 609,7 | 507,4 | 465,0 |
| 4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). | | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,0053% | 0,0053% | 0,0053% | 0,0053% | 0,0053% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 2,05% | 2,05% | 2,05% | 2,05% | 2,05% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 2,05% | 2,05% | 2,05% | 2,05% | 2,05% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 33,0 | 31,0 | 38,0 | 33,0 | 12,0 |
| Tasa de interés | 0,45% | 0,45% | 0,45% | 0,45% | 0,45% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 516,4 | 454,4 | 571,7 | 474,4 | 453,0 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 3 275,4 | 3 246,4 | 3 227,8 | 3 205,8 | 3 160,0 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,0 | 7,0 | 6,9 | 6,9 | 6,8 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 918,2 | 869,3 | 870,6 | 848,6 | 802,8 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,0 | 1,9 | 1,9 | 1,8 | 1,7 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 411,0 | 317,0 | 493,0 | 810,0 | 773,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,00/1,25/1,21 | 1,23/1,25/1,23 | 1,20/1,23/1,23 | 1,23/1,23/1,23 | 1,20/1,25/1,23 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 94,0 | 133,0 | 160,0 | 139,0 | 210,9 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 0,55/0,60/0,60 | 0,55/0,60/0,55 | 0,55/0,55/0,55 | 0,55/0,55/0,55 | 0,55/0,55/0,55 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR | 277,0 | 280,0 | 512,7 | 165,8 | 304,6 |
| 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\$) | 12 febrero | 15 febrero | 16 febrero | 17 febrero | 18 febrero |
| Flujo de la posición global = a + b - c - d + e + f | 23,3 | -26,9 | -19,4 | 65,7 | -18,7 |
| Flujo de la posición contable = a + b - c - d + e + f | 23,3 | 36,9 | 116,5 | 77,3 | 83,0 |
| a. Mercado spot con el público | 77,6 | 50,5 | 43,1 | 66,9 | 85,1 |
| i. Compras | 193,2 | 159,4 | 223,2 | 193,2 | 203,3 |
| ii. (-) Ventas | 115,6 | 108,9 | 180,1 | 126,3 | 119,2 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 9,2 | -3,0 | 9,3 | 42,0 | -158,3 |
| i. Pactadas | 96,6 | 83,5 | 73,0 | 103,1 | 79,5 |
| ii. (-) Vencidas | 87,4 | 118,4 | 63,7 | 61,1 | 237,7 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 9,7 | 30,9 | 145,2 | 53,7 | -56,5 |
| i. Pactadas | 109,3 | 70,7 | 172,7 | 85,9 | 94,3 |
| ii. (-) Vencidas | 99,6 | 39,8 | 27,5 | 32,3 | 150,7 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 389,0 | 156,4 | 206,6 | 375,0 | 269,0 |
| ii. A futuro | 23,0 | 35,0 | 2,0 | 5,0 | 105,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -47,4 | -88,1 | 4,4 | -17,4 | -74,1 |
| i. Compras | 35,0 | 25,4 | 6,7 | 7,0 | 142,8 |
| ii. (-) Ventas | 83,4 | 113,6 | 1,7 | 24,4 | 216,8 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 5,8 | -2,0 | 32,8 | -1,1 | -15,0 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,8556 | 2,8541 | 2,8488 | 2,8475 | 2,8507 |
| (*) Datos preliminares. | | | | | |
| d. = día(s) | | | | | |
| s. = semana(s) | | | | | |
| m. = mes(es) | | | | | |
| a. = año(s) | | | | | |