

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

	30 Enero	31 Enero	1 Febrero	2 Febrero	3 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-761,5	-537,8	-799,5	-1 184,5	-412,2
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	6 991,3	6 991,3	6 991,3	6 991,3	6 641,3
Próximo vencimiento de CDBCRP (3 de febrero de 2006)					320,0
Vencimientos de CDBCRP del 1 al 3 de febrero de 2006					0,0
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>	400,0 480,0 70,0	200,0 435,0	500,0 890,0 100,0	900,0 950,0 8,0	411,0 226,5 200,0
Propuestas recibidas	535,0 533,0 73,6	315,0 465,0	812,0 955,0 105,0	1 248,0 961,0 8,0	411,0 226,5 222,0
Plazo de vencimiento	1 semana 1 día 1 día	1 semana 1 día	1 semana 1 día 1 día	1 semana 1 día 1 día	1 semana 3 días 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,74/3,78/3,75 3,58/3,70/3,60 3,65/3,70/3,65	3,76/3,81/3,79 3,51/3,65/3,59	3,80/3,90/3,81 3,61/3,73/3,62 3,61/3,75/3,62	3,83/3,86/3,83 3,59/3,68/3,62 3,70/3,70/3,70	3,81/3,87/3,83 3,72/3,79/3,75 3,83/3,83/3,83
Saldo	3 250,0	3 035,0	3 590,0	3 558,0	2 837,5
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDRBCRP)</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	1 231,6	1 231,6	1 231,6	1 231,6	1 231,6
Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 marzo de 2006)	35,0	35,0	35,0	35,0	35,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	1,6
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					0,5
Tipo de cambio promedio					3,2840
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	188,5	97,2	690,5	673,5	426,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0046%	0,0046%	0,0046%	0,0046%	0,0056%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%	4,50%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés					
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	65,0	32,1	0,0	0,0	0,0
Tasa de interés	2,75%	2,75%	2,75%	2,75%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	123,5	65,1	690,5	673,5	426,9
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 360,0	1 351,7	1 783,1	1 774,5	1 689,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	7,3	7,2	9,7	9,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	323,6	315,3	690,5	682,0	596,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	2,8	3,7	3,3
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	77,9	217,0	64,5	82,5	73,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,60/3,75/3,73	3,50/3,75/3,56	3,80/3,85/3,81	3,70/3,80/3,75	3,80/3,85/3,83
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	33,0	59,0	30,0	33,0	28,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,07/4,15/4,14	4,00/4,30/4,10	4,15/4,15/4,15	4,15/4,15/4,15	4,15/4,15/4,15
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	12,9	10,6	0,0	2,7	19,1
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		5,0/4,80			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Enero	30 Enero	31 Enero	1 Febrero	2 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-33,3	-1,5	-0,4	41,7	19,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-45,3	14,2	22,7	1,8	4,1
a. <u>Mercado spot con el público</u>	-50,3	-2,0	19,5	13,5	44,3
i. Compras	88,6	81,0	93,4	80,9	119,1
ii. (-) Ventas	138,9	83,0	73,8	67,5	74,7
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	10,3	6,7	19,1	14,4	-101,9
i. Pactadas	50,1	28,1	34,7	40,5	14,4
ii. (-) Vencidas	39,8	21,3	15,6	26,1	116,3
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-1,6	22,4	42,2	-25,5	-116,8
i. Pactadas	64,9	44,4	47,8	47,4	32,6
ii. (-) Vencidas	66,6	22,0	5,6	72,8	149,4
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	72,0	89,5	94,3	92,0	80,2
ii. A futuro	4,0	5,0	7,0	3,0	17,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	31,8	-10,8	-12,4	48,6	-7,9
i. Compras	59,8	5,7	0,8	72,6	107,5
ii. (-) Ventas	28,0	16,5	13,2	24,0	115,4
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	0,0	27,7	5,5	-13,5	0,8
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,316	3,306	3,315	3,307	3,313
(*) Datos preliminares					