

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

	8 Enero	9 Enero	10 Enero	11 Enero	12 Enero	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarizadas antes de las operaciones del BCR	1,307.2	1,435.5	1,293.2	1,918.9	392.4	
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 (CDRBCRP)						
Propuestas recibidas	50.0 100.0 80.0 100.0 61.0 350.0	75.0 100.0 150.0 450.0 400.1	100.0 100.0 175.0 375.0 300.1 13.5	100.0 100.0 175.0 275.0 200.0 70.0	100.0 95.0 98.0	
Plazo de vencimiento	164.0 177.0 196.0 280.0 61.0 476.0	200.0 210.0 337.0 529.0 445.0	242.5 189.0 311.0 400.0 328.0 13.5	178.5 138.0 290.0 290.0 360.0 96.0	202.0 103.0 98.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5.83%/6.85%/5.83 5.12%/5.20%/5.19 4.89%/5.05%/5.01 4.52%/4.67%/4.56 4.37%/4.44%/4.41 4.37%/4.44%/4.39 9.19%/5.5	5.00%/5.00%/5.00 5.18%/5.20%/5.17 4.76%/4.79%/4.77 4.46%/4.46%/4.46 4.23%/4.41%/4.36	5.78%/5.78%/5.78 5.18%/5.18%/5.18 4.76%/4.79%/4.77 4.50%/4.50%/4.50 4.08%/4.41%/4.32 4.46%/4.49%/4.49	5.45%/5.45%/5.45 5.16%/5.16%/5.16 4.77%/4.80%/4.79 4.43%/4.57%/4.52 4.26%/4.26%/4.26 4.50%/4.57%/4.54	5.77%/5.80%/5.80 5.16%/5.16%/5.16 4.77%/4.80%/4.79 4.43%/4.57%/4.52 4.26%/4.26%/4.26 4.50%/4.57%/4.54	5.77%/5.80%/5.80 5.16%/5.16%/5.16 4.77%/4.80%/4.79 4.43%/4.57%/4.52 4.26%/4.26%/4.26 4.50%/4.57%/4.54
Saldo	9,196.5	9,771.6	10,010.1	10,184.5	10,057.5	
Próximo vencimiento de CDRBCRP (10 de enero de 2007)					159.0	
Vencimientos de CDRBCRP del 10 al 12 de enero de 2007					1,424.0	
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 Reajustable del BCR (CDRBCRP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio						
Saldo						
Próximo vencimiento de CDRBCRP	281.4	26.8	0.0	159.6	281.4	
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Regulación del BCR						
i. Compras (millones de US\$)	60.0	30.0	0.0	50.0	60.0	
Tipo de cambio promedio	3,191.2	3,192.7		3,191.2	3,190.5	
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						
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarizadas en el BCR al cierre de operaciones	757.7	381.3	254.6	287.6	280.6	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)						
Comisión (base efectiva diaria)	0.0079%	0.0079%	0.0079%	0.0079%	0.0068%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)						
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional						
Tasa de interés	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	5.25%	
d. Depósitos Overight en moneda nacional						
Tasa de interés	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	3.75%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarizadas en el BCR al cierre de operaciones	768.1	328.7	218.5	221.5	250.3	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2,051.7	2,051.7	2,026.4	1,993.8	1,976.4	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9.3	9.2	9.0	8.8	8.7	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	601.8	571.4	536.1	507.5	486.1	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.7	2.5	2.4	2.2	2.1	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDRBCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	32.0	22.0	102.9	229.0	80.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.30%/4.40%/4.36	4.35%/4.35%/4.35	4.30%/4.40%/4.37	4.23%/4.40%/4.36	4.23%/4.50%/4.37	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	20.0	41.0	39.0	39.0	50.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5.40%/5.50%/5.48	5.40%/5.50%/5.49	5.50%/5.50%/5.50	5.50%/5.50%/5.50	5.50%/5.50%/5.50	
c. Total mercado secundario de CDRBCRP	45.0	42.6	5.0	16.2	35.0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	1,114.92	1,114.92	0.0	0.0	0.0	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	2,051.16	4,051.13				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				2,051.47		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarizadas (millones de US\$)		8 Enero	9 Enero	10 Enero	11 Enero	
Flujo de la posición global = a + b - c - e + f	-21.2	-17.1	-9.5	66.2	-14.7	
Flujo de la posición contable = a + b - c - e + f	13.6	-45.6	-5.4	36.8	-29.9	
a. Mercado spot con el público	19.2	18.0	18.6	58.2	14.8	
i. Compras	105.4	103.6	156.6	108.0	168.9	
ii. (i) Ventas	86.3	87.6	138.0	59.7	134.0	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-2.7	-28.1	60.7	57.6	-39.4	
i. Placadas	16.4	43.0	93.9	176.0	148.2	
ii. (i) Vencidas	21.1	17.0	43.2	108.4	187.6	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-24.1	-24.8	-52.8	-38.4	-28.8	
i. Placadas	48.2	3.1	98.0	71.4	21.2	
ii. (i) Vencidas	18.1	3.1	3.2	33.1	75.8	
d. Operaciones cambiarias interbancarias						
i. Al contado	62.0	72.5	75.8	50.5	102.5	
ii. A futuro	5.0	0.0	0.0	13.0	20.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-150.0	-150.0	-37.0	79.2	-215.2	
i. Compras	10.0	4.9	3.0	24.0	70.7	
ii. (i) Ventas	20.0	15.0	40.0	104.2	185.9	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1.5	-53.0	-27.0	-7.6	-61.6	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,192	3,191	3,192	3,194	3,191	
(*) Datos preliminares						