

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

	19 Febrero	20 Febrero	21 Febrero	22 Febrero	23 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	603,6	728,5	539,4	603,9	671,1
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)	<u>65,0</u> <u>100,0</u>	<u>500,0</u>	<u>395,0</u>	<u>425,0</u> <u>100,0</u>	<u>70,0</u> <u>100,0</u> <u>100,0</u> <u>300,0</u>
Propuestas recibidas	65,0 170,0	544,0	398,0	529,0 150,0	185,0 163,5 202,0 341,0
Plazo de vencimiento	1 semana 1 día	1 día	1 día	1 día 1 día	1 año 1 mes 1 semana 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,56/4,60/4,59 4,34/4,38/4,36	4,41/4,53/4,48	4,49/4,53/4,49	4,49/4,53/4,52 4,49/4,53/4,52	5,18/5,25/5,21 4,69/4,70/4,70 4,57/4,60/4,58 4,47/4,52/4,48
Saldo	11 636,4	11 836,4	11 707,4	11 717,4	11 598,4
Próximo vencimiento de CDBCRP (21 de febrero del 2007)					365,0
Vencimientos de CDBCRP del 21 al 23 de febrero del 2007					659,0
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 Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDRBCRP					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>127,5</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>95,7</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)	40,0			30,0	
Tipo de cambio promedio	3,1885			3,1898	
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	45,0				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	466,1	228,5	144,4	174,6	101,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0058%
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 Overnight en moneda nacional	<u>101,0</u>	<u>85,3</u>	<u>49,0</u>	<u>32,0</u>	<u>13,5</u>
Tasa de interés	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	365,1	143,2	95,4	142,6	87,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 709,3	1 697,0	1 683,6	1 673,6	1 662,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,1	7,1	7,0	7,0	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	389,5	377,2	363,7	353,7	342,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	1,6	1,5	1,5	1,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>397,2</u>	<u>440,1</u>	<u>471,3</u>	<u>354,7</u>	<u>512,1</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,35/4,55/4,45	4,40/4,50/4,45	4,45/4,50/4,48	4,45/4,50/4,50	4,45/4,55/4,51
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>14,4</u>	<u>8,0</u>	<u>4,0</u>	<u>6,0</u>	<u>7,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,50/5,55/5,50	5,55/5,55/5,55	5,50/5,50/5,50	5,50/5,50/5,50	5,50/5,50/5,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP	<u>40,8</u>	<u>66,5</u>	<u>14,0</u>	<u>14,0</u>	<u>34,5</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			3,0/5,55		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	16 Febrero	19 Febrero	20 Febrero	21 Febrero	22 Febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-36,3	-20,3	-13,8	45,3	-49,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-40,1	-23,5	0,9	47,4	-39,0
a. Mercado spot con el público	<u>32,9</u>	<u>13,3</u>	<u>31,1</u>	<u>28,5</u>	<u>22,6</u>
i. Compras	128,2	90,9	109,1	103,0	103,8
ii. (-) Ventas	95,3	77,6	78,0	74,5	81,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	<u>75,7</u>	<u>-3,1</u>	<u>138,4</u>	<u>108,5</u>	<u>-241,1</u>
i. Pactadas	117,1	13,1	236,0	165,7	20,8
ii. (-) Vencidas	41,5	16,2	96,6	57,3	261,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<u>71,9</u>	<u>-6,3</u>	<u>153,1</u>	<u>110,5</u>	<u>-230,9</u>
i. Pactadas	84,4	1,4	266,4	138,5	31,8
ii. (-) Vencidas	12,5	7,7	113,3	27,9	262,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	89,5	48,3	136,7	104,2	92,2
ii. A futuro	0,0	20,0	13,0	22,0	13,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<u>-11,2</u>	<u>-12,1</u>	<u>11,0</u>	<u>-31,5</u>	<u>-3,8</u>
i. Compras	11,1	0,4	93,0	23,7	252,2
ii. (-) Ventas	22,4	12,5	82,0	55,2	256,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>-90,8</u>	<u>-33,2</u>	<u>-24,5</u>	<u>21,0</u>	<u>-57,0</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,187	3,188	3,190	3,189	3,189