

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

	19 Marzo	20 Marzo	21 Marzo	22 Marzo	23 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	945,0	1 037,4	669,6	832,1	491,0
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	50,0 644,0	50,0 100,0 727,0	50,0 50,0 401,0	50,0 100,0 550,0	50,0 470,1 55,0
Plazo de vencimiento	110,0 644,0 1 año 1 día	131,5 243,0 727,0 1 año 1 semana 1 día	132,0 157,0 401,0 1 año 1 semana 1 día	130,0 207,0 582,0 1 año 1 semana 1 día	152,0 532,0 55,0 1 año 3 días 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,12/5,15/5,14 4,49/4,53/4,52	5,13/5,15/5,14 4,58/4,60/4,60 4,49/4,53/4,53	5,10/5,13/5,10 4,58/4,59/4,59 4,49/4,53/4,53	5,09/5,09/5,09 4,58/4,60/4,58 4,49/4,53/4,51	5,09/5,10/5,09 4,50/4,52/4,52 4,50/4,52/4,50
Saldo	12 029,5	12 172,5	11 946,5	11 995,5	12 020,6 625,1 875,1
Próximo vencimiento de CDBCRP (21 de marzo del 2007)					
Vencimientos de CDBCRP del 21 al 23 de marzo del 2007					
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					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	31,9	0,0	0,0	222,9
i. Compras (millones de US\$)		10,0			70,0
Tipo de cambio promedio		3,1870			3,1845
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 bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	251,0	192,3	168,6	132,1	138,8
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	41,9	34,6	47,5	21,1	14,3
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	209,1	157,7	121,1	111,0	124,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 894,3	1 878,0	1 861,5	1 846,1	1 832,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	7,6	7,6	7,2	7,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	483,5	467,2	450,7	435,3	421,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	1,9	1,8	1,7	1,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	198,5	283,5	345,9	293,4	185,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,50/4,49	4,45/4,55/4,49	4,45/4,50/4,50	4,45/4,50/4,49	4,45/4,50/4,49
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	54,0	49,0	65,0	47,0	25,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,50/5,55/5,50	5,50/5,55/5,50	5,50/5,55/5,52	5,50/5,55/5,52	5,50/5,55/5,54
c. Total mercado secundario de CDBCRP	2,0	108,5	70,0	74,9	5,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					5,0/5,09
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	16 Marzo	19 Marzo	20 Marzo	21 Marzo	22 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-41,5	11,0	-18,0	6,7	22,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-25,2	21,3	34,1	-6,3	4,8
a. Mercado spot con el público	11,4	18,2	57,5	23,7	26,8
i. Compras	140,0	133,3	122,0	81,2	108,4
ii. (-) Ventas	128,5	115,1	64,5	57,4	81,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-20,6	-105,4	-220,4	-101,3	23,1
i. Pactadas	62,9	54,5	12,0	15,3	44,1
ii. (-) Vencidas	83,5	159,9	232,4	116,6	20,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-4,4	-95,2	-168,3	-114,3	5,9
i. Pactadas	61,5	53,7	28,8	20,2	32,8
ii. (-) Vencidas	65,8	148,8	197,1	134,5	26,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	114,0	63,0	82,7	53,0	95,5
ii. A futuro	0,0	26,0	30,0	5,0	16,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-13,1	-9,9	-48,1	-5,7	-10,0
i. Compras	59,9	145,0	181,9	106,3	10,0
ii. (-) Ventas	73,0	154,9	230,0	112,0	20,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-41,3	2,0	-10,6	-6,5	-6,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,186	3,186	3,187	3,186	3,186