

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

	28 Enero	29 Enero	30 Enero	31 Enero	01 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 229,6	5 368,0	5 480,7	5 596,3	4 516,9
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>	--	--	--	--	--
Saldo	23 971,4	23 971,4	23 971,4	23 971,4	23 971,4
Próximo vencimiento de CDBCRP (08 febrero del 2008)	1 600,0				1 600,0
Vencimientos de CDBCRP del 30 de enero al 1 de febrero del 2008	0,0				0,0
ii. <u>Subasta de compra temporal de valores</u>					
Saldo					
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>					
Saldo					
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	4 500,0	100,0 500,0 3725,0	100,0 500,0 3699,9	83,0 1000,0 4300,0	
Propuestas recibidas	5 488,9	235,0 1818,0 5297,5	255,0 1817,5 5599,4	298,0 2078,0 4334,0	
Plazo de vencimiento	1 d.	11 m. 1 s. 1 d.	11 m. 1 s. 1 d.	11 m. 1 s. 1 d.	
Tasas de interés: Mínima	4,00	5,79 4,00 4,05	5,97 4,00 3,80	5,96 4,00 3,90	
Máxima	4,71	5,99 4,48 4,70	6,00 4,15 4,65	5,98 4,50 5,15	
Promedio	4,44	5,93 4,17 4,51	5,98 4,14 4,47	5,98 4,21 4,66	
Saldo	4 500,0	4 325,0	4 899,9	6 583,0	2 283,0
Próximo vencimiento de Depósitos (30 de enero de 2008)	4 500,0	3 725,0	3 699,9	4 300,0	0,0
Vencimientos de Depósitos del 30 de enero al 1 de febrero del 2008	4 500,0	3 725,0	3 699,9	4 300,0	2 000,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	223,3	666,6	731,3	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>	76,0	227,0	249,0		
Tipo de cambio promedio	2,9378	2,9366	2,9369		
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	952,8	1 709,6	1 912,1	213,3	4 516,9
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)	0,0086%	0,0086%	0,0086%	0,0086%	0,0097%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%	6,00%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	880,0	1 657,6	1 870,5	123,5	2 160,6
Tasa de interés	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	72,8	52,0	41,6	89,8	2 356,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S./.) (*)	2 982,2	2 930,7	2 882,4	2 838,7	3 794,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,2	9,0	8,9	8,7	33,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S./.)	1 543,6	1 492,2	1 443,8	1 400,2	2 356,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,7	4,6	4,4	4,3	21,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	101,0	13,0	123,0	104,4	90,0
Tasas de interés: Mínima / Promedio	0,50/4,55/4,25	4,60/4,60/4,60	4,50/4,50/4,50	4,50/4,65/4,52	4,30/4,50/4,41
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	14,6	3,0	0,5	0,5	90,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,00/4,50/4,02	4,00/4,00/4,00	4,50/4,50/4,50	4,50/4,50/4,50	4,50/6,50/5,74
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	163,9	148,9	203,8	80,1	16,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		2,2/5,25		3,0/5,83	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	25 Enero	28 Enero	29 Enero	30 Enero	31 Enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-108,4	6,0	-53,7	41,2	131,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-227,5	-36,0	-149,2	-178,7	161,5
a. <u>Mercado spot con el público</u>	23,1	99,9	77,4	63,5	147,7
i. Compras	175,2	242,4	197,6	246,4	380,2
ii. (-) Ventas	151,7	142,5	120,2	182,9	232,5
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	118,5	98,2	160,8	259,3	0,0
i. Pactadas	163,2	182,2	211,5	311,8	253,8
ii. (-) Vencidas	42,5	84,0	50,7	52,5	253,8
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-0,6	56,2	65,3	39,4	30,3
i. Pactadas	70,5	161,5	112,7	66,3	175,9
ii. (-) Vencidas	71,1	105,3	47,4	26,9	145,6
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	224,0	182,2	169,0	190,0	138,0
ii. A futuro	35,0	84,0	32,0	5,0	49,4
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-27,5	-43,0	-6,7	-25,5	-105,4
i. Compras	13,5	26,0	40,3	21,5	137,1
ii. (-) Ventas	41,0	69,0	47,0	47,0	242,5
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-194,5	-71,6	-223,2	-242,3	11,0
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,934	2,9366	2,9357	2,9364	2,9330
(*) Datos preliminares					