

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Nuevos Soles)

	26 Enero	27 Enero	28 Enero	29 Enero	30 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-2 348,0	-3 105,5	-3 403,0	-3 558,4	-4 049,5
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	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3	4 342,3
Próximo vencimiento de CD BCRP (09 de febrero del 2009)					470,0
Vencimientos de CD BCRP del 02 al 06 de febrero del 2009					0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>	2 899,9	3723 200,0	3 750,0 240,0	4 469,9	4 500,1 350,0
Propuestas recibidas	2 990,0	3723 250,0	4 675,0 286,0	4 637,5	5 468,8 430,0
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d. 1 d.	1 d. 1d.	1 d.	3 d. 3 d.
Tasas de interés: Mínima	6,63	6,65 6,53	6,69 6,82	6,72	6,55 6,87
Máxima	6,67	6,69 6,53	6,72 6,82	7,32	7,28 7,03
Promedio	6,65	6,65 6,53	6,71 6,82	6,84	7,02 6,89
Saldo	3 989,0	4 312,1	4 379,1	4 859,0	5 239,2
Próximo vencimiento de Repo (02 febrero del 2009)					4 850,1
Vencimientos de Repo del 02 al 06 de febrero del 2009					4 850,1
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)</u>	150,0	300,0 85,0		105,0	
Propuestas recibidas	158,0	395,0 85,0		105,0	
Plazo de vencimiento	3 m.	3 m. 3 m.		3 m.	
Tasas de interés: Mínima	1,55	1,55 1,55		1,57	
Máxima	1,67	1,57 1,65		1,67	
Promedio	1,64	1,56 1,62		1,58	
Saldo	5 025,1	5 410,1	5 410,1	5 515,1	5 515,1
Próximo vencimiento de CDRBCRP (02 de febrero del 2009)			0,0		0,0
Vencimientos de CDR BCRP del 02 al 06 de febrero del 2009			0,0		0,0
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</u>					
Saldo	6 483,1	6 483,1	6 483,1	6 483,1	6 483,1
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (09 de Febrero del 2009)					
Vencimientos de CDBCRP del 02 al 06 de febrero del 2009				957,0	957,0
vi. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u>	0,0	0,0	0,0		0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0		0,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>			66,0	138,0	36,0
Tipo de cambio promedio			3,1638	3,1685	3,1843
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
d. <u>Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR</u>					
ii. <u>Compras de BTP</u>					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	401,9	432,5	378,2	369,2	686,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps).</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0175%	0,0174%	0,0174%	0,0174%	0,0184%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta).</u>					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional.</u>					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional.</u>	98,4	30,8	139,9	35,4	177,5
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	303,5	401,7	238,3	333,8	508,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 107,5	3 073,1	3 035,4	3 003,6	2 979,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,2	7,1	7,1	7,0	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 328,9	1 294,6	1 256,9	1 225,0	1 201,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,1	3,0	2,9	2,8	2,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional.</u>	486,5	424,7	647,5	464,8	509,3
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,50/6,67/6,57	6,50/6,80/6,57	6,50/6,72/6,61	6,50/7,32/6,72	6,50/7,30/7,18
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	1,2	1,3	4,3	20,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,15/0,15/0,15	0,15/0,15/0,15	0,15/0,20/0,19	0,20/0,20/0,20	0,30/0,30/0,30
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u>	2,0	30,0	1,0	146,0	28,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	23 enero	23 enero	27 enero	28 enero	29 enero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	66,5	66,5	106,5	-17,9	-54,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	59,8	59,8	111,7	-2,1	141,2
a. <u>Mercado spot con el público.</u>	-41,8	-41,8	-13,2	-62,6	-37,8
i. Compras	188,7	188,7	188,8	154,4	206,0
ii. (-) Ventas	230,4	230,4	202,0	216,9	243,8
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega).</u>	81,2	81,2	50,7	-113,5	-61,0
i. Pactadas	101,7	101,7	99,8	102,0	71,6
ii. (-) Vencidas	20,6	20,6	49,2	215,4	132,6
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega).</u>	74,4	74,4	55,9	-97,7	134,8
i. Pactadas	90,7	90,7	81,9	70,6	256,8
ii. (-) Vencidas	16,3	16,3	26,0	168,3	122,0
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	297,7	297,7	271,4	348,4	225,7
ii. A futuro	8,5	8,5	0,5	33,0	84,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega.</u>	-18,0	-18,0	-21,0	-45,6	-4,8
i. Compras	0,4	0,4	26,0	168,0	120,9
ii. (-) Ventas	18,4	18,4	47,0	213,6	125,7
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras.</u>	115,3	115,3	122,8	59,0	173,1
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera.</u>					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1621	3,1621	3,1619	3,1632	3,1680
(*) Datos preliminares					