

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

	09 Febrero					10 Febrero			11 Febrero			12 Febrero			13 Febrero		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-165,8					496,7			351,9			-718,7			-446,5		
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)																	
Saldo	3 872,3					3 872,3			3 872,3			3 872,3			3 872,3		
Próximo vencimiento de CD BCRP (13 de abril del 2009)																	
Vencimientos de CD BCRP del 11 al 13 de febrero del 2009																	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	100,0	408,0	500,0	600,1	300,0	300,0	1000,0	234,0	1 050,0	-499,9	500,0	600,0	500,0	500,0	500,0		
Propuestas recibidas	200,0	676,0	850,0	1 273,0	608,0	920,0	1454,0	234,0	1 323,0	1 288,0	1 400,0	1 400,0	750,0	1 190,0	1 070,0		
Plazo de vencimiento	3 m.	1 m.	1 s.	1 d.	1 d.	1 m.	1 d.	1 d.	1 d.	1 m.	1 s.	1 d.	1 m.	1 s.	1 d.		
Tasas de interés: Mínima	6,43	6,35	6,32	6,43	6,43	6,35	6,52	6,26	6,36	6,37	6,36	6,43	6,37	6,33	6,43		
Máxima	6,43	6,41	6,35	6,61	6,63	6,47	6,53	6,55	6,53	6,58	6,36	6,51	6,37	6,37	6,48		
Promedio	6,43	6,38	6,33	6,45	6,56	6,38	6,52	6,32	6,51	6,40	6,36	6,49	6,37	6,36	6,45		
Saldo	5 327,2					5 961,1			5 427,1			5 477,0			5 877,0		
Próximo vencimiento de Repo (11 febrero del 2009)																	
Vencimientos de Repo del 11 al 13 de febrero del 2009																	
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDR-BCRP)	200,0					300,0			182,0			300,0			-		
Propuestas recibidas	272,0					427,0			182,0			340,0			-		
Plazo de vencimiento	4 m.					4 m.			4 m.			4 m.			-		
Tasas de interés: Mínima	1,10					1,65			1,70			1,79			-		
Máxima	1,85					1,83			1,85			1,81			-		
Promedio	1,71					1,78			1,80			1,80			-		
Saldo	7 099,1					7 581,1			7 881,1			7 881,1			7 881,1		
Próximo vencimiento de CDRBCRP (20 de febrero del 2009)																	
Vencimientos de CDR BCRP del 11 al 13 de febrero del 2009																	
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	0,0					0,0			0,0			0,0			0,0		
Saldo	0,0					0,0			0,0			0,0			0,0		
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (02 de Marzo del 2009)																	
Vencimientos de CDBCRP del 11 al 13 de febrero del 2009																	
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)	5 526,1					5 526,1			5 526,1			5 526,1			5 526,1		
Saldo	5 526,1					5 526,1			5 526,1			5 526,1			5 526,1		
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (02 de Marzo del 2009)																	
Vencimientos de CDBCRP del 11 al 13 de febrero del 2009																	
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera	0,0					0,0			0,0			0,0			0,0		
Saldo	0,0					0,0			0,0			0,0			0,0		
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0					-155,3			0,0			-32,4			0,0		
i. Compras (millones de US\$)																	
Tipo de cambio promedio																	
ii. Ventas (millones de US\$)																	
Tipo de cambio promedio																	
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0					0,0			0,0			0,0			0,0		
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público																	
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público																	
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0					0,0			0,0			0,0			0,0		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR																	
ii. Compras de BTP																	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 542,2					1 393,4			1 101,9			848,9			1 053,5		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones																	
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).																	
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0171%					0,0171%			0,0170%			0,0171%			0,0171%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)																	
Tasa de interés	7,00%					7,00%			7,00%			7,00%			7,00%		
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional																	
Tasa de interés	7,00%					7,00%			7,00%			7,00%			7,00%		
d. Depósitos Overnight en moneda nacional																	
Tasa de interés	5,50%					5,50%			5,50%			5,50%			5,50%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 525,7					1 357,4			1 047,9			668,4			701,9		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 762,6					3 735,9			3 686,0			3 612,8			3 553,4		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,8					8,7			8,6			8,4			8,3		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 623,9					1 597,2			1 547,3			1 474,1			1 414,7		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,8					3,7			3,6			3,4			3,3		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																	
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	369,5					590,0			569,7			771,5			692,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,25/6,50/6,49					6,25/6,50/6,29			6,25/6,45/6,26			6,20/6,35/6,30			6,25/6,30/6,30		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	21,6					29,5			54,0			15,0			0,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,34/0,35/0,35					0,34/0,35/0,4			0,35/0,35/0,35			0,35/0,35/0,35			0,35/0,35/0,35		
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	0,5					32,0			20,5			79,2			1,0		
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\$)	06 febrero					09 febrero			10 febrero			11 febrero			12 febrero		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-17,3					16,0			108,6			-96,3			33,7		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	8,7					-66,3			173,0			-71,3			-8,9		
a. Mercado spot con el público	-7,4					-127,7			-21,4			-139,8			-13,5		
i. Compras	233,0					173,5			152,1			165,6			178,9		
ii. (-) Ventas	240,4					301,2			173,4			305,4			192,4		
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-28,0					68,9			-44,3			-4,5			-159,1		
i. Pactadas	44,8					114,7			69,9			70,0			20,7		
ii. (-) Vencidas	72,7					45,8			114,3			74,6			179,9		
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-1,9					-13,3			20,1			20,5			-201,8		
i. Pactadas	85,3					56,2			121,9			113,7			129,6		
ii. (-) Vencidas	87,2					69,5			101,8			93,2			331,4		
d. Operaciones cambiarias interbancarias																	
i. Al contado	316,9					304,6			273,2			296,7			337,0		
ii. A futuro	23,4					13,0			55,0			78,1			21,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0,8					16,1			-19,1			0,5			144,0		
i. Compras	69,6					55,1			91,5			72,0			300,6		
ii. (-) Ventas	68,8					39,0			110,6			71,5			156,5		
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	29,8					69,1			201,0			86,7			12,0		
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																	
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,2246					3,2204			3,2351			3,2380			2,2325		
(*) Datos preliminares																	