

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

	16 Febrero	17 Febrero	18 Febrero	19 Febrero	20 Febrero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-1,1	210,6	-66,0	-605,8	-1 582,1
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)					
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)					877,6
Vencimientos de CD BCRP del 18 al 20 de febrero del 2009					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)	500,0 500,0	400,0 453,0	400,0 517,1	1 450,0 380,0	2 865,1
Propuestas recibidas	500,0 500,0	560,0 453,0	730,0 517,1	1 450,0 380,0	2 866,6
Plazo de vencimiento	1 s. 1 d.	1 s. 1 d.	1 s. 1 d.	1 d. 1 d.	3 d.
Tasas de interés: Mínima	6,38 6,51	6,46 6,30	6,42 6,25	6,26 6,41	6,26
Máxima	6,38 6,51	6,46 6,53	6,49 6,50	6,62 6,41	6,55
Promedio	6,38 6,51	6,46 6,46	6,46 6,46	6,45 6,41	6,39
Saldo	5 877,0	6 230,0	6 694,1	7 507,0	8 042,1
Próximo vencimiento de Repo (18 febrero del 2009)					3 365,1
Vencimientos de Repo del 18 al 20 de febrero del 2009					4 165,1
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)	177,0 124,0	100,0 74,0	237,0 97,0	340,0 145,0 300,0	100,0 40,0 100,0 85,0
Propuestas recibidas	177,0 144,0	340,0 103,0	347,0 257,0	550,0 245,0 355,0	485,0 425,0 125,0 85,0
Plazo de vencimiento	5 m. 4 m.	4 m. 4 m.	4 m. 6 m.	5 m. 6 m. 4 m.	6 m. 5 m. 3 m. 3 m.
Tasas de interés: Mínima	1,80 1,75	1,89 1,90	1,90 2,20	2,08 2,29 1,93	2,26 2,09 1,65 1,62
Máxima	2,04 1,96	1,89 1,96	1,96 2,25	2,11 2,29 1,98	2,26 2,09 1,74 1,75
Promedio	1,96 1,93	1,89 1,95	1,92 2,22	1,93 1,98 1,97	2,26 2,09 1,67 1,72
Saldo	8 182,1	8 356,1	8 690,1	9 475,1	9 845,1
Próximo vencimiento de CDRBCRP (20 de febrero del 2009)					60,0
Vencimientos de CDR BCRP del 18 al 20 de febrero del 2009					360,0
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
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)				2 062,0	2 062,0
Vencimientos de CDBCRP del 18 al 20 de febrero del 2009				0	0,0
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	-330,8	-103,8	0,0	-130,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)		102,0	32,0		40,0
Tipo de cambio promedio		3,2434	3,2450		3,2509
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	697,9	558,8	413,3	439,2	468,0
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%	0,0171%	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	333,6	215,6	4,3	7,4	43,3
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	364,3	343,2	409,0	431,8	424,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 398,6	3 344,7	3 300,4	3 262,0	3 227,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,9	7,7	7,6	7,5	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 259,9	1 206,0	1 161,7	1 123,3	1 088,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,8	2,7	2,6	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	495,7	549,4	471,9	410,9	410,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,30/6,35/6,31	6,25/6,35/6,31	6,30/6,49/6,30	6,30/6,50/6,31	6,30/6,40/6,33
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	0,0	57,0	40,0	0,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			0,35/0,35/0,35	0,34/0,35/0,35	0,22/0,35/0,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	78,5	103,0	30,0	40,0	5,0
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\$)	13 febrero	16 febrero	17 febrero	18 febrero	19 febrero
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-67,4	65,0	40,6	3,5	168,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-21,4	77,5	55,4	99,9	196,3
a. Mercado spot con el público	-27,0	-16,5	-92,4	-46,1	-49,6
i. Compras	137,4	111,6	167,9	188,4	173,4
ii. (-) Ventas	164,3	128,1	260,3	234,5	222,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	32,1	-19,4	110,5	-80,4	-125,3
i. Pactadas	64,5	12,4	124,2	28,6	44,4
ii. (-) Vencidas	32,4	31,9	13,6	109,0	169,8
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	78,1	-7,0	125,4	16,0	-97,1
i. Pactadas	88,9	10,3	136,2	197,9	101,6
ii. (-) Vencidas	10,8	17,3	10,8	181,9	198,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	217,2	268,4	241,7	223,9	231,3
ii. A futuro	17,1	30,4	5,0	33,0	25,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-17,1	-15,6	-2,6	76,9	27,9
i. Compras	4,9	14,7	10,0	181,4	197,2
ii. (-) Ventas	22,0	30,3	12,6	104,5	169,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,0	95,0	147,6	142,0	246,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,2286	3,2356	3,2450	3,2435	3,2462
(*) Datos preliminares					