

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

| | 23 Febrero | 24 Febrero | 25 Febrero | 26 Febrero | 27 Febrero |
|--|-------------------------|------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | -2 699,5 | -3 229,5 | -3 848,4 | -3 734,8 | -3 714,3 |
| 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 25 al 27 de febrero del 2009 | | | | | 0,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | 3 371,0 | 3 699,9 | 4 070,0 | 4 050,0 | 4 000,1 |
| Propuestas recibidas | 3 371,0 | 3 808,5 | 4 070,0 | 4 142,0 | 4 370,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 3 d. |
| Tasas de interés: Mínima | 6,26 | 6,25 | 6,27 | 6,27 | 6,33 |
| Máxima | 6,48 | 6,43 | 6,38 | 6,38 | 6,35 |
| Promedio | 6,36 | 6,30 | 6,30 | 6,30 | 6,34 |
| Saldo | 8 048,0 | 8 048,0 | 7 947,0 | 7 927,0 | 7 877,1 |
| Próximo vencimiento de Repo (25 febrero del 2009) | | | | | 4 500,1 |
| Vencimientos de Repo del 25 al 27 de febrero del 2009 | | | | | 5 000,1 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP) | 82,0 145,0 142,0 | 150,0 15,0 32,0 | | | 300,0 |
| Propuestas recibidas | 102,0 145,0 147,0 | 180,0 115,0 47,0 | | | 310,0 |
| Plazo de vencimiento | 6 m. 5 m. 3 m. | 6 m. 5 m. 3 m. | | | 6 m. |
| Tasas de interés: Mínima | 2,24 2,03 1,72 | 2,24 2,10 1,74 | | | 2,19 |
| Máxima | 2,25 2,11 1,75 | 2,24 2,10 1,74 | | | 2,29 |
| Promedio | 2,25 2,10 1,75 | 2,24 2,10 1,74 | | | 2,23 |
| Saldo | 10 154,1 | 10 351,1 | 10 351,1 | 10 351,1 | 10 351,1 |
| Próximo vencimiento de CDRBCRP (27 de febrero del 2009) | | | | | 300,0 |
| Vencimientos de CDR BCRP del 25 al 27 de febrero del 2009 | | | | | 330,0 |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | | | | | |
| 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 |
| Vencimientos de CDBCRP del 25 al 27 de febrero del 2009 | | | | | 2 062,0 |
| vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera | | | | | |
| Saldo | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 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 | 302,5 | 273,4 | 221,6 | 315,2 | 285,8 |
| 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% | 0,0177% | 0,0177% | 0,0180% |
| 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 | 22,5 | 12,4 | 10,8 | 107,9 | 78,0 |
| 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 | 280,0 | 261,0 | 210,8 | 207,3 | 207,8 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 3 134,2 | 3 103,6 | 3 073,4 | 3 045,5 | 3 019,6 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,5 | 7,4 | 7,3 | 7,3 | 7,2 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 995,5 | 964,9 | 934,7 | 906,8 | 880,9 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,4 | 2,3 | 2,2 | 2,2 | 2,1 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 406,0 | 462,3 | 515,7 | 372,5 | 616,3 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 6,30/6,30/6,30 | 6,20/6,40/6,30 | 6,25/6,35/6,31 | 6,30/6,35/6,32 | 6,30/6,45/6,36 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 0,9 | 1,0 | 1,2 | 11,0 | 10,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 0,19/0,19/0,19 | 0,20/0,20/0,20 | 0,20/0,20/0,20 | 0,10/0,25/0,20 | 0,10/0,40/0,22 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR | 8,0 | 10,0 | 20,0 | 19,0 | 63,3 |
| 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\$) | 19 febrero | 23 febrero | 24 febrero | 25 febrero | 26 febrero |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 168,0 | 78,2 | -98,1 | -4,3 | 32,6 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 196,3 | 69,8 | 13,1 | -61,2 | -44,3 |
| a. Mercado spot con el público | -49,6 | -35,5 | -47,1 | -52,4 | -50,6 |
| i. Compras | 173,4 | 114,2 | 155,0 | 124,5 | 102,2 |
| ii. (-) Ventas | 222,9 | 149,8 | 202,2 | 176,9 | 152,8 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -125,3 | -6,1 | -55,5 | 2,1 | -58,1 |
| i. Pactadas | 44,4 | 43,7 | 79,6 | 96,1 | 119,0 |
| ii. (-) Vencidas | 169,8 | 49,8 | 135,1 | 94,0 | 177,1 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -97,1 | -14,5 | 55,7 | -54,8 | -135,1 |
| i. Pactadas | 101,6 | 53,8 | 128,0 | 61,6 | 94,2 |
| ii. (-) Vencidas | 198,6 | 68,4 | 72,2 | 116,4 | 229,3 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 231,3 | 233,3 | 306,2 | 475,0 | 302,2 |
| ii. A futuro | 25,0 | 50,0 | 100,0 | 155,0 | 50,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 27,9 | 23,6 | -63,2 | 19,5 | 54,4 |
| i. Compras | 197,2 | 62,5 | 71,6 | 104,6 | 226,7 |
| ii. (-) Ventas | 169,3 | 38,9 | 134,8 | 85,1 | 172,3 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 246,8 | 100,3 | 60,6 | -6,0 | 4,0 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,2462 | 3,2484 | 3,2514 | 3,2460 | 3,2425 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |