

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

	16 Marzo	17 Marzo	18 Marzo	19 Marzo	20 Marzo
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-1 275,6	-1 638,5	-1 630,2	-975,0	-780,3
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	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 marzo del 2009					0,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo)</u>	2 100,1 102,0	500,0 1 835,0	500,0 1 700,0	50,0 500,0 662,0	200,0 800,0
Propuestas recibidas	2 265,0 102,0	743,0 1 835,0	700,0 1 821,0	150,0 665,0 662,0	800,0 1 550,0
Plazo de vencimiento	1 d. 1 s.	1 s. 1 d.	1 s. 1 d.	1 m. 1 s. 1 d.	1 m. 3 d.
Tasas de interés: Mínima	6,03 6,00	6,03 6,03	6,03 6,00	6,00 6,03 6,00	6,00 6,05
Máxima	6,19 6,03	6,07 6,05	6,03 6,03	6,00 6,04 6,03	6,01 6,08
Promedio	6,05 6,03	6,04 6,03	6,03 6,00	6,00 6,03 6,03	6,01 6,08
Saldo	7 177,5	6 912,4	6 877,4	6 389,4	6 141,1
Próximo vencimiento de Repo (18 marzo del 2009)	2 600,1				902,0
Vencimientos de Repo del 18 al 20 de marzo del 2009	3 586,4				2 402,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDR-BCRP)</u>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	10 916,1	10 916,1	10 916,1	10 916,1	10 916,1
Próximo vencimiento de CDRBCRP (24 de marzo del 2009)					75,0
Vencimientos de CDR BCRP del 18 al 20 de marzo del 2009					75,0
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	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	3 464,1	3 464,1	3 464,1	3 464,1	3 464,1
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (13 de Abril del 2009)	85,0		85,0		85,0
Vencimientos de CDBCRP del 18 al 20 de marzo del 2009	0,0		0,0		0,0
vi. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera</u>		100,0	200,0	100,0 200,0 100,0	200,0 180,0
Propuestas recibidas		230,0	391,5	185,0 334,6 121,0	260,0 180,0
Plazo de vencimiento		1 s.	1 s.	1 m. 1 s. 1 s.	1 m. 1 s.
Tasas de interés: Mínima		6,09	6,03	6,00 6,03 6,03	6,00 6,00
Máxima		6,09	6,14	6,00 6,07 6,03	6,00 6,11
Promedio		6,09	6,09	6,00 6,03 6,03	6,00 6,05
Saldo	0,0	100,0	300,0	700,0	1 080,0
Próximo vencimiento de Repo (24 de marzo del 2009)					100,0
Vencimientos de Repo del 18 al 20 de enero del 2009					600,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
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	926,5	796,5	769,8	637,0	599,7
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%	0,0175%	0,0175%	0,0175%	0,0175%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	6,75%	6,75%	6,75%	6,75%	6,75%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	6,75%	6,75%	6,75%	6,75%	6,75%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	471,5	295,7	477,0	264,2	296,5
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	455,0	500,8	292,8	372,8	303,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 509,8	3 453,1	3 391,2	3 340,0	3 290,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,5	8,3	8,2	8,1	7,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1 464,0	1 407,3	1 345,4	1 294,2	1 244,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,5	3,4	3,2	3,1	3,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	529,3	415,0	830,5	788,5	847,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,00/6,15/6,06	6,00/6,10/6,06	6,00/6,05/6,01	6,00/6,05/6,00	6,00/6,05/6,04
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	22,5	24,0	24,5	15,8	10,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,02/0,20/0,10	0,02/0,15/0,09	0,02/0,10/0,08	0,02/0,20/0,14	0,20/0,20/0,20
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u>	65,2	0,0	0,0	5,0	4,0
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 Marzo	16 Marzo	17 Marzo	18 Marzo	19 Marzo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-23,5	-68,0	-20,3	60,1	-42,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	12,0	-8,6	15,1	15,5	-144,2
a. <u> Mercado spot con el público</u>	9,0	70,2	53,8	65,9	13,9
i. Compras	185,6	323,1	218,4	224,2	247,8
ii. (-) Ventas	176,6	252,8	164,3	158,3	233,8
b. <u> Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-12,9	-33,9	23,3	-46,2	2,2
i. Pactadas	20,9	124,0	62,5	111,4	91,9
ii. (-) Vencidas	33,7	157,9	39,2	157,6	89,8
c. <u> Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	22,7	25,5	58,7	-90,8	-99,2
i. Pactadas	168,2	302,7	130,8	164,2	145,3
ii. (-) Vencidas	145,5	277,2	72,1	255,0	244,5
d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	391,6	584,3	457,1	449,0	614,2
ii. A futuro	50,0	100,0	108,0	108,0	68,0
e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	104,9	63,5	5,2	38,0	11,7
i. Compras	135,8	219,0	40,3	191,0	101,0
ii. (-) Ventas	30,9	155,5	35,1	153,0	89,3
f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	10,0	-23,0	-11,0	9,0	-15,0
g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,1747	3,1495	3,1469	3,1461	3,1094
(*) Datos preliminares					