

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones S/.)

	21 Agosto	22 Agosto	23 Agosto	24 Agosto	25 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	433,1	364,9	363,3	324,1	274,7
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)	<u>50,0</u> <u>106,0</u> <u>165,0</u>	<u>180,0</u>	<u>30,0</u> <u>170,0</u>	<u>30,0</u> <u>24,0</u> <u>173,0</u>	<u>165,0</u>
Propuestas recibidas	87,0 141,0 215,0	200,0	87,0 223,0	47,0 67,0 173,0	216,0
Plazo de vencimiento	3 meses 1 semana 1 día	1 semana	3 meses 1 semana	2 años 6 meses 1 semana	1 semana
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,98/4,98/4,98 4,59/4,64/4,63 4,41/4,49/4,47	4,63/4,64/4,64	4,93/4,98/4,97 4,59/4,64/4,62	5,84/5,94/5,89 5,15/5,25/5,20 4,61/4,63/4,63	4,59/4,65/4,61
Saldo	5 462,2	5 477,2	5 477,2	5 415,7	5 450,7
Próximo vencimiento de CDBCRP (23 de agosto de 2006)					106,0
Vencimientos de CDBCRP del 23 al 25 de agosto de 2006					824,0
ii. Subasta de compra temporal de valores	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	457,8	433,8	433,8	433,8	403,8
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	670,0	670,0	670,0	670,0	670,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 de diciembre de 2006)	270,0	270,0	270,0	270,0	270,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>35,5</u>	<u>37,2</u>	<u>17,8</u>	<u>3,2</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)	11,0	11,5	5,5	1,0	
Tipo de cambio promedio	3,2311	3,2339	3,2350	3,2365	
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	147,6	222,1	181,1	130,3	79,7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0078%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<u>0,0</u>	<u>3,0</u>	<u>71,0</u>	<u>43,0</u>	<u>5,25%</u>
Tasa de interés	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	147,6	219,1	110,1	87,3	79,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 559,3	1 547,2	1 537,1	1 528,2	1 519,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,9	7,8	7,8	7,7	7,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	311,6	307,4	298,9	290,0	281,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	1,6	1,5	1,5	1,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>137,0</u>	<u>207,0</u>	<u>171,5</u>	<u>147,0</u>	<u>159,5</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/4,55/4,52	4,50/4,55/4,53	4,50/4,55/4,51	4,35/4,55/4,48	4,45/4,55/4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>7,0</u>	<u>3,0</u>	<u>3,0</u>	<u>3,0</u>	<u>0,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP	<u>22,0</u>	<u>3,0</u>	<u>15,0</u>	<u>13,0</u>	<u>12,0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	1,0/5,20		7,0/5,15	6,0/5,25	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	18 Agosto	21 Agosto	22 Agosto	23 Agosto	24 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	35,0	33,8	-39,5	-3,4	-3,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	40,1	41,2	-36,3	14,6	46,3
a. Mercado spot con el público	<u>79,0</u>	<u>40,9</u>	<u>24,9</u>	<u>22,8</u>	<u>25,9</u>
i. Compras	144,3	105,0	129,0	95,7	102,8
ii. (-) Ventas	65,3	64,2	104,1	72,9	76,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	<u>61,1</u>	<u>-29,0</u>	<u>-65,4</u>	<u>-26,7</u>	<u>32,9</u>
i. Pactadas	99,5	17,0	52,4	9,6	46,3
ii. (-) Vencidas	38,4	46,0	117,9	36,3	13,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<u>66,2</u>	<u>-21,6</u>	<u>-62,2</u>	<u>-8,7</u>	<u>83,0</u>
i. Pactadas	141,5	15,1	68,9	45,7	104,6
ii. (-) Vencidas	75,3	36,7	131,0	54,4	21,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	36,5	30,0	74,5	34,0	29,5
ii. A futuro	0,0	0,0	16,0	8,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<u>17,5</u>	<u>-15,4</u>	<u>-19,8</u>	<u>11,4</u>	<u>7,6</u>
i. Compras	55,5	5,3	72,4	46,4	20,2
ii. (-) Ventas	38,0	20,8	92,2	35,0	12,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-19,5	6,5	-28,2	-1,5	21,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,228	3,231	3,233	3,234	3,236
(*) Datos preliminares					