

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

	02 Octubre	03 Octubre	04 Octubre	05 Octubre	06 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	485,8	462,3	312,1	189,6	118,5
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)	0,0	0,0	30 40	50 100 50	50,0 150,0 50,0
Propuestas recibidas			103,5 50	85 200 50	154,0 225,0 94,0
Plazo de vencimiento			92 días 7 días	3 meses 1 día 1 día	3 meses 3 días 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			4,82/4,84/4,83 4,55/4,55/4,55	4,81/4,81/4,81 4,45/4,45/4,45 4,45/4,45/4,45	4,80/4,80/4,80 4,39/4,39/4,39 4,20/4,38/4,24
Saldo	4 629,5	4 629,5	4 639,5	4 839,5	4 889,5
Próximo vencimiento de CDBCRP (04 de octubre de 2006)	60,0				200,0
Vencimientos de CDBCRP del 04 al 06 de octubre de 2006	60,0				390,0
ii. Subasta de compra temporal de valores	165 50 100 50	225,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas	406 163 228 50	352,0			
Plazo de vencimiento	1 día 1 día 1 día 1 día				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,60/4,62/4,61 4,62/4,62/4,62 4,57/4,60/4,59 4,55/4,55/4,55	4,54/4,56/4,54			
Saldo	518,8	378,8	153,8	106,0	106,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	13,0	30,8	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)	4,0	9,5			
Tipo de cambio promedio	3,2470	3,2470			
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	863,8	858,1	677,1	554,6	483,5
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)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%
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	0,0	0,0	0,0	0,0	160,0
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	863,8	858,1	677,1	554,6	323,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 616,2	1 751,2	1 730,1	1 718,9	1 673,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,1	8,0	8,5	8,4	8,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	453,3	588,2	610,4	599,3	553,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	2,7	3,0	2,9	2,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	258,0	213,0	244,0	152,5	256,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,60/4,60/4,60	4,50/4,55/4,53	4,45/4,50/4,48	4,45/4,50/4,48	4,40/4,50/4,47
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	11,0	26,0	32,5	15,0	5,0
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					
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\$)	29 Septiembre	02 Octubre	03 Octubre	04 Octubre	05 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	30,7	-18,7	-47,5	32,1	13,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-15,1	-37,7	-34,3	41,4	-15,3
a. Mercado spot con el público	-1,6	-6,1	-23,8	43,5	10,8
i. Compras	134,7	89,5	134,9	92,3	71,7
ii. (-) Ventas	136,3	95,7	158,7	48,8	60,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	64,1	40,7	-3,1	25,4	-51,7
i. Pactadas	138,1	44,7	106,0	82,3	39,3
ii. (-) Vencidas	73,9	4,0	109,1	56,9	90,9
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	18,4	21,6	10,0	34,8	-80,3
i. Pactadas	52,3	104,2	54,8	51,3	22,4
ii. (-) Vencidas	33,9	82,6	44,7	16,6	102,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	108,8	30,3	74,5	51,5	58,0
ii. A futuro	33,0	28,0	33,0	5,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-33,6	76,0	-65,4	-40,4	5,2
i. Compras	28,9	79,2	43,3	16,5	94,0
ii. (-) Ventas	62,5	3,2	108,7	56,9	88,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-20,0	-29,0	-9,5	-2,0	-19,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,248	3,249	3,247	3,250	3,250
(*) Datos preliminares					