

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

	23 Octubre	24 Octubre	25 Octubre	26 Octubre	27 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	80,9	257,8	433,5	366,7	246,8
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)	140,0	50,0	30,0	30,0	50,0
Propuestas recibidas	278,0	111,0	83,0	108,0	108,0
Plazo de vencimiento	1 semana	1 día	1 año	1 año	1 semana
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,52/4,56/4,55	4,34/4,53/4,49	4,98/4,99/4,99	4,56/4,56/4,56	4,52/4,52/4,52
Saldo	5 338,5	5 506,4	5 505,5	5 526,5	5 576,5
Próximo vencimiento de CDBCRP (25 de octubre de 2006)		379,9			140,0
Vencimientos de CDBCRP del 25 al 27 de octubre de 2006		479,9			560,0
ii. Subasta de compra temporal de valores	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	322,1	161,2	96,8	0,0	64,3
i. Compras (millones de US\$)	100,0	50,0	30,0		20,0
Tipo de cambio promedio	3,2210	3,2230	3,2272		3,2173
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	151,0	139,0	151,3	166,7	261,1
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	35,5	3,2	52,0	111,8	194,5
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	115,5	135,8	99,3	54,9	66,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 441,6	1 433,8	1 425,2	1 415,6	1 407,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	7,0	6,9	6,9	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	321,9	314,2	305,6	295,9	287,4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	1,5	1,5	1,4	1,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	352,8	284,0	196,0	147,1	255,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,55/4,51	4,45/4,55/4,50	4,45/4,55/4,52	4,50/4,50/4,50	4,45/4,50/4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	5,0	5,0	5,6	6,6	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30	
c. Total mercado secundario de CDBCRP	0,0	25,3	14,0	65,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			2,0/5,00	48,0/4,99	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			2,0/5,41		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Octubre	23 Octubre	24 Octubre	25 Octubre	26 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	21,5	-43,2	6,7	15,7	22,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	3,1	-130,0	-46,5	-84,3	12,1
a. Mercado spot con el público	46,5	-15,4	-2,1	-51,0	6,8
i. Compras	164,5	87,5	72,3	63,4	71,1
ii. (-) Ventas	118,0	103,0	74,4	114,4	64,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-25,9	30,5	42,4	34,1	-2,8
i. Pactadas	84,9	99,1	88,2	88,5	19,7
ii. (-) Vencidas	110,8	68,6	45,9	54,4	22,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-44,3	-56,3	-10,8	-65,9	-13,5
i. Pactadas	41,6	52,4	29,1	50,3	13,5
ii. (-) Vencidas	85,9	108,7	39,9	116,2	27,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	67,3	53,5	47,5	111,0	24,0
ii. A futuro	23,0	15,0	17,0	15,0	16,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-9,1	28,2	-7,0	57,5	2,3
i. Compras	85,8	96,3	36,0	109,8	23,0
ii. (-) Ventas	94,9	68,1	43,0	52,3	20,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-59,1	-102,7	-43,4	-29,0	7,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,232	3,221	3,223	3,226	3,227
(*) Datos preliminares					