

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

	7 Mayo						8 Mayo						9 Mayo						10 Mayo						11 Mayo					
	2 184,6						2 013,4						1 666,7						1 843,0						1 585,3					
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR																														
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)																														
Propuestas recibidas	50,0	50,0	200,0	12,0	930,0	150,0	50,0	50,0	100,0	1.250,0	100,0	75,0	50,0	150,0	1.229,9	50,0	75,0	50,0	150,0	1.300,1	30,0	50,0	100,1	1.255,0						
Plazo de vencimiento	170,0	133,0	307,0	33,0	1.210,0	334,0	201,0	126,0	218,0	1.499,0	100,0	110,5	82,0	217,0	1.330,0	131,0	182,5	79,0	210,0	1.414,0	59,0	74,0	157,0	1.255,0						
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,41/5,43/5,42	5,25/5,31/5,27	5,06/5,11/5,09	4,89/4,91/4,90	4,34/4,38/4,38	4,30/4,30/4,30	5,48/5,50/5,50	5,27/5,29/5,28	5,05/5,09/5,09	4,23/4,49/4,45	4,48/4,49/4,49	5,41/5,45/5,43	5,28/5,29/5,29	5,06/5,09/5,08	4,41/4,41/4,41	4,23/4,23/4,23	5,49/5,52/5,50	5,28/5,31/5,30	5,09/5,09/5,09	4,26/4,41/4,39	5,42/5,46/5,44	5,29/5,29/5,29	5,10/5,12/5,11	4,30/4,50/4,47						
Saldo	12 679,5						13 149,5						13 229,4						13 704,6						1 255,0					
Próximo vencimiento de CDBCRP (9 de mayo del 2007)																														
Vencimientos de CDBCRP el 9 al 11 de mayo del 2007																														
ii. Subasta de compra temporal de valores																														
Propuestas recibidas																														
Plazo de vencimiento																														
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio																														
Saldo																														
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDRBCRP)																														
Propuestas recibidas																														
Plazo de vencimiento																														
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio																														
Saldo																														
Próximo vencimiento de CDRBCRP																														
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	47,5						180,0						349,3						126,7						70,3					
i. Compras (millones de US\$)	15,0						60,0						110,0						40,0						25,0					
Tipo de cambio promedio	3,1672						3,1660						3,1660						3,1678						3,1701					
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	830,1						653,4						479,0						394,6						184,5					
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)	0,0048%						0,0048%						0,0048%						0,0048%						0,0048%					
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 Overnights en moneda nacional																														
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	653,6						521,3						329,4						328,8						184,5					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 107,2						2 083,2						2 046,5						2 014,1						1 974,5					
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,7						8,6						8,4						8,3						8,1					
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	713,3						689,3						652,6						620,3						580,6					
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,0						2,8						2,7						2,5						2,4					
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																														
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	118,0						74,0						277,7						150,0						232,2					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,40/4,50/4,49						4,30/4,50/4,40						4,30/4,50/4,45						4,45/4,50/4,48						4,30/4,50/4,44					
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	13,0						14,5						17,0						3,0						30,5					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,00/6,00/6,00						6,00/6,25/6,16						6,25/6,25/6,25						6,25/6,25/6,25						6,00/6,30/6,17					
c. Total mercado secundario de CDBCRP	41,5						19,91						140,8						72,0						138,2					
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\$)																														
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-114,4						-29,7						-29,6						-28,8						-28,4					
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-185,9						23,9						-11,6						-40,3						-24,4					
a. Mercado spot con el público	46,2						25,5						43,8						48,8						24,4					
i. Compras	141,4						148,2						207,6						194,0						194,0					
ii. (c) Ventas	95,2						122,7						164,1						89,3						169,6					
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	119,9						-36,2						27,7						119,3						-41,8					
i. Pactadas	135,8						65,0						147,8						167,8						155,9					
ii. (c) Ventas	29,9						101,2						120,1						48,5						197,7					
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	39,3						17,4						-13,6						105,7						-39,6					
i. Pactadas	42,5						52,4						15,0						121,1						96,9					
ii. (c) Ventas	3,2						35,1						28,7						15,3						136,5					
d. Operaciones cambiarias interbancarias																														
i. Al contado	132,5						107,2						129,5						39,1						118,7					
ii. A futuro	43,0						32,0						40,0						35,0						60,8					
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-3,0						-58,3						-32,4						-32,4						-21,2					
i. Compras	1,0						29,0						23,5						14,5						125,9					
ii. (c) Ventas	4,0						86,3						109,0						46,6						197,5					
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-250,8						-2,5						-61,0						-110,0						-40,2					
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																														
Tasa de interés																														
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,166						3,167						3,166						3,166						3,167					