

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

| | 4 Junio | | | | 5 Junio | | | | 6 Junio | | | | 7 Junio | | | | 8 Junio | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------|----------------|--|
| | 2,296,4 | | | | 2,451,3 | | | | 2,559,1 | | | | 2,494,1 | | | | 2,338,9 | | | |
| 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 | 1800,0 | 50,1 | 30,0 | 50,0 | 50,0 | 2027,0 | 30,0 | 70,0 | 70,0 | 2010,0 | 30,0 | 100,0 | 100,0 | 1900,0 | 70,0 | -- | 1800,0 | |
| Plazo de vencimiento | 1 año | 6 meses | 1 día | 1 día | 2 años | 1 año | 6 meses | 1 día | 2 años | 1 año | 6 meses | 1 día | 3 años | 1 año | 6 meses | 1 día | 1 año | 6 meses | 3 días | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5,15/5,18/5,16 | 4,86/4,88/4,88 | 4,38/4,53/4,47 | 4,53/4,53/4,53 | 5,48/5,50/5,49 | 5,15/5,16/5,16 | 4,87/4,87/4,87 | 4,41/4,53/4,51 | 5,40/5,45/5,43 | 5,14/5,14/5,14 | 4,88/4,88/4,88 | 4,45/4,53/4,51 | 5,51/5,52/5,52 | 5,16/5,16/5,16 | 4,93/4,95/4,95 | 4,45/4,53/4,51 | 5,18/5,25/5,25 | -- | 4,48/4,52/4,52 | |
| Saldo | 16.334,5 | | | | 16.611,4 | | | | 16.764,4 | | | | 16.884,4 | | | | 1.800,0 | | | |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (6 de junio del 2007) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Vencimientos de CDBCRP del 6 al 8 junio del 2007 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ii. Subasta de compra temporal de valores | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 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 | 174,4 | | | | 110,9 | | | | 31,7 | | | | 0,0 | | | | 0,0 | | | |
| i. Compras (millones de US\$) | 55,0 | | | | 35,0 | | | | 10,0 | | | | | | | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | 3,1700 | | | | 3,1698 | | | | 3,1702 | | | | | | | | | | | |
| 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 | 520,6 | | | | 435,2 | | | | 410,8 | | | | 364,1 | | | | 438,9 | | | |
| 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 Overnight en moneda nacional | 0,0 | | | | 0,0 | | | | 0,0 | | | | 0,0 | | | | 0,0 | | | |
| 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 | 520,6 | | | | 432,2 | | | | 410,8 | | | | 364,1 | | | | 438,9 | | | |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 2.270,6 | | | | 2.159,8 | | | | 2.085,0 | | | | 2.025,0 | | | | 1.989,3 | | | |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,0 | | | | 8,5 | | | | 8,1 | | | | 7,9 | | | | 7,7 | | | |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 966,1 | | | | 859,3 | | | | 784,6 | | | | 724,5 | | | | 688,8 | | | |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 3,8 | | | | 3,4 | | | | 3,1 | | | | 2,8 | | | | 2,7 | | | |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 153,0 | | | | 70,0 | | | | 107,0 | | | | 178,0 | | | | 191,1 | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,40/4,50/4,45 | | | | 4,45/4,50/4,50 | | | | 4,50/4,50/4,50 | | | | 4,43/4,50/4,47 | | | | 4,50/4,55/4,50 | | | |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 0,0 | | | | 0,0 | | | | 0,0 | | | | 19,0 | | | | 39,0 | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | | | | | | | | | 6,00/6,00/6,00 | | | | 6,15/6,15/6,15 | | | |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 191,7 | | | | 16,7 | | | | 59,0 | | | | 45,8 | | | | 90,0 | | | |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | | | | | | | | | | | | | 4,0/5,46 | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 01 Junio | | | | 4 Junio | | | | 5 Junio | | | | 6 Junio | | | | 7 Junio | | | |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 27,6 | | | | -49,6 | | | | -12,3 | | | | 9,9 | | | | -38,8 | | | |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | -75,2 | | | | -2,4 | | | | 79,0 | | | | 21,3 | | | | 113,5 | | | |
| a. Mercado spot con el público | 83,3 | | | | 31,8 | | | | 91,2 | | | | 12,2 | | | | 86,4 | | | |
| i. Compras | 179,2 | | | | 108,4 | | | | 190,7 | | | | 111,5 | | | | 225,3 | | | |
| ii. (-) Ventas | 96,0 | | | | 76,6 | | | | 99,5 | | | | 93,3 | | | | 138,9 | | | |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 113,1 | | | | 49,2 | | | | 13,2 | | | | -7,5 | | | | -174,8 | | | |
| i. Pactadas | 137,8 | | | | 88,1 | | | | 107,4 | | | | 75,0 | | | | 144,1 | | | |
| ii. (-) Vencidas | 24,7 | | | | 44,9 | | | | 94,2 | | | | 82,5 | | | | 318,9 | | | |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | 10,2 | | | | 90,4 | | | | 104,4 | | | | 3,9 | | | | -22,5 | | | |
| i. Pactadas | 32,4 | | | | 90,5 | | | | 109,6 | | | | 67,3 | | | | 153,3 | | | |
| ii. (-) Vencidas | 22,1 | | | | 0,1 | | | | 5,2 | | | | 63,4 | | | | 175,8 | | | |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| i. Al contado | 176,5 | | | | 51,5 | | | | 106,5 | | | | 132,0 | | | | 125,0 | | | |
| ii. A futuro | 13,0 | | | | 13,0 | | | | 0,0 | | | | 5,0 | | | | 19,0 | | | |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -9,1 | | | | -33,0 | | | | -23,8 | | | | -2,0 | | | | -121,5 | | | |
| i. Compras | 20,0 | | | | 0,0 | | | | 0,9 | | | | 57,0 | | | | 173,0 | | | |
| ii. (-) Ventas | 29,1 | | | | 33,0 | | | | 74,7 | | | | 59,0 | | | | 294,5 | | | |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -161,0 | | | | -46,0 | | | | -27,5 | | | | -7,9 | | | | 5,5 | | | |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,172 | | | | 3,170 | | | | 3,169 | | | | 3,170 | | | | 3,173 | | | |