

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

	4 Diciembre	5 Diciembre	6 Diciembre					7 Diciembre				
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	775,3	813,7	919,1					924,6				
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)		80,0	50,0	50,0	30,0	80,0	200,0	50,0	50,0	200,0	30,0	200,0
Propuestas recibidas		220,0	130,0	83,8	80,0	165,0	470,0	122,0	133,0	263,0	48,0	286,0
Plazo de vencimiento		1 día	2 años	1 año	6 meses	1 semana	1 día	2 años	1 año	1 semana	1 semana	4 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		4,23/4,23/4,23	5,54/5,56/5,54	5,03/5,25/5,15	5,00/5,10/5,04	4,53/4,53/4,53	4,41/4,41/4,41	5,52/5,53/5,53	5,12/5,12/5,12	4,51/4,56/4,54	4,54/4,54/4,54	4,37/4,44/4,43
Saldo	6 485,5	6 565,5	6 795,5					7 125,5				
Próximo vencimiento de CDBCRP (6 de Diciembre de 2006)								200,0				
Vencimientos de CDBCRP del 6 al 7 de diciembre de 2006								510,0				
ii. Subasta de compra temporal de valores	50,0	80,0	0,0					0,0				
Propuestas recibidas	110,0	114,0	80,0					80,0				
Plazo de vencimiento	1 día	1 día	1 día					1 día				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,66/4,66/4,66	4,67/4,67/4,67	4,56/4,56/4,56					4,56/4,56/4,56				
Saldo	130,0	80,0	0,0					0,0				
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)			0,0					0,0				
Propuestas recibidas			670,0					670,0				
Plazo de vencimiento			270,0					270,0				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			670,0					670,0				
Saldo	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				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	16,1	96,4	48,2					48,1				
i. Compras (millones de US\$)	5,0	30,0	15,0					15,0				
Tipo de cambio promedio	3,2149	3,2121	3,2121					3,2098				
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	921,4	910,1	607,3					442,7				
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones												
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)			0,0078%					0,0067%				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0078%	0,0078%	0,0078%					0,0067%				
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			5,25%					5,25%				
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%					5,25%				
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			5,25%					5,25%				
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%					5,25%				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	35,2	23,1					149,0				
Tasa de interés	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	921,4	874,9	584,2					293,7				
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 914,3	1 938,5	1 906,2					1 841,6				
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,0	9,0	8,9					8,5				
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	753,9	778,1	745,8					681,2				
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,5	3,6	3,5					3,2				
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP												
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	488,0	170,0	285,6					225,0				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/4,65/4,61	4,30/4,55/4,48	4,35/4,50/4,47					4,40/4,50/4,47				
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	5,0	0,0					0,0				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		5,35/5,35/5,35										
c. Total mercado secundario de CDBCRP	35,6	58,0	23,0					124,0				
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)								4,0/4,99				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			13,0/4,99					3,0/5,12				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	13,0/5,52											
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	1 Diciembre	4 Diciembre	5 Diciembre					6 Diciembre				
Flujo de la posición global = a + b.i - c.j + e + f	-69,6	-24,9	-24,9					6,1				
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-59,7	25,3	-22,1					24,5				
a. Mercado spot con el público	-5,9	36,1	1,1					42,0				
i. Compras	114,5	118,7	97,6					155,8				
ii. (-) Ventas	120,5	82,6	96,5					113,8				
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	61,9	-63,8	45,7					-9,2				
i. Pactadas	67,2	23,7	93,8					83,2				
ii. (-) Vencidas	5,3	87,5	48,1					92,5				
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	71,8	-13,6	-15,6					9,2				
i. Pactadas	77,9	11,5	21,9					87,6				
ii. (-) Vencidas	6,1	25,1	37,5					78,4				
d. Operaciones cambiarias interbancarias												
i. Al contado	61,5	73,5	55,0					88,5				
ii. A futuro	0,0	0,3	5,0					15,0				
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-5,0	-65,2	-9,3					5,0				
i. Compras	0,0	16,5	6,7					75,0				
ii. (-) Ventas	5,0	81,7	16,0					70,0				
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-48,0	-8,0	-24,5					-36,5				
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera												
Tasa de interés												
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,215	3,215	3,212					3,213				
(*) Datos preliminares												