

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

	11 Diciembre	12 Diciembre	13 Diciembre	14 Diciembre	15 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	675,0	-253,7	-83,3	199,3	225,8
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)					
Propuestas recibidas	28,0 200,0 250,0	30,0		0,0	
Plazo de vencimiento	70,0 256,0 305,0	38,0			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3 años 1 semana 1 día	3 años			
Saldo	5,73/5,90/5,81 4,55/4,59/4,58 4,38/4,41/4,38	5,90/5,94/5,92	7 153,5	6 923,5	6 923,5
Próximo vencimiento de CDBCRP (12 de Diciembre de 2006)	7 425,5	7 203,5	230,0	200,0	200,0
Vencimientos de CDBCRP del 12 al 15 de diciembre de 2006	250,0	80,0	230,0	0,0	580,0
Saldo	560,0	310,0	230,0	0,0	230,0
ii. Subasta de compra temporal de valores		380,0 130,0	320,0 50,0	75,0 30,0 50,0	230,0
Propuestas recibidas		705,0 180,0	460,0 115,0	185,5 85,0 50,0	330,0
Plazo de vencimiento		1 día 1 día	1 día 1 día	1 día 1 día 1 día	1 día
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		4,51/4,61/4,52 4,51/4,54/4,51	4,53/4,62/4,61 4,56/4,65/4,59	4,64/4,64/4,64 4,66/4,76/4,74 4,83/4,83/4,83	4,67/4,67/4,67
Saldo	0,0	510,0	370,0	155,0	230,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	670,0	670,0	400,0	400,0	400,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 de diciembre de 2006)	270,0	270,0	150,0	150,0	150,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	96,2	0,0	16,0	64,2	224,2
i. Compras (millones de US\$)	30,0		5,0	20,0	70,0
Tipo de cambio promedio	3,2081		3,2099	3,2087	3,2024
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	30,0				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	271,2	228,3	272,7	418,5	680,0
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%	0,0068%
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					
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	238,2	211,8	267,7	418,5	308,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 695,7	1 668,7	1 650,2	1 645,1	1 633,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,8	7,6	7,6	7,6	7,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	535,2	508,3	489,8	484,7	472,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,5	2,3	2,2	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	171,7	507,0	454,8	473,2	354,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,55/4,49	4,45/4,60/4,52	4,45/4,60/4,54	4,45/4,70/4,55	4,45/4,60/4,53
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	20,0	23,0	21,0	5,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		5,35/5,35/5,35	5,35/5,35/5,35	5,35/5,35/5,35	5,20/5,35/5,28
c. Total mercado secundario de CDBCRP		2,0	6,0	41,0	48,0
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\$)	7 Diciembre	11 Diciembre	12 Diciembre	13 Diciembre	14 Diciembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-38,0	4,2	62,7	-33,7	11,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-10,8	0,8	64,3	-120,0	27,2
a. Mercado spot con el público	4,3	61,3	53,5	32,1	81,7
i. Compras	119,7	185,5	174,6	117,0	169,1
ii. (-) Ventas	115,4	124,3	121,1	85,0	87,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-7,4	-34,2	66,5	95,8	-120,4
i. Pactadas	6,1	64,0	69,3	151,0	9,1
ii. (-) Vencidas	13,5	98,2	2,8	55,2	129,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	19,8	-37,6	68,0	9,4	-104,6
i. Pactadas	26,9	45,9	74,4	151,2	24,7
ii. (-) Vencidas	7,1	83,5	6,4	141,7	129,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	103,0	87,0	69,0	279,5	219,5
ii. A futuro	0,0	25,0	27,0	18,5	52,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-10,2	-38,2	1,5	53,9	-3,9
i. Compras	1,0	36,8	1,5	107,1	121,7
ii. (-) Ventas	11,2	75,0	0,0	53,2	125,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-11,3	-37,0	12,8	-119,5	-50,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,211	3,208	3,212	3,213	3,208
(*) Datos preliminares					