

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

	28 Mayo	29 Mayo	30 Mayo	31 Mayo	1 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1.970,5	1.963,8	1.851,7	1.819,1	1.734,0
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	30,0 50,0 1810,0	30,0 50,0 50,0 1851,0	30,0 50,0 50,0 1484,0	30,0 30,0 1666,5	1.100,0
Plazo de vencimiento	83,0 105,0 1810,0	130,0 90,0 130,0 1851,0	70,0 67,0 77,0 1484,0	71,0 73,0 1666,5	1.100,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3 años 11 meses 1 día	2 años 1 año 6 meses 1 día	3 años 1 año 6 meses 1 día	2 años 6 meses 1 día	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,45/5,46/5,46 5,04/5,04/5,04 4,38/4,53/4,42	5,38/5,40/5,39 5,12/5,12/5,12 4,80/4,80/4,80 4,45/4,53/4,45	5,46/5,50/5,48 5,14/5,17/5,16 4,82/4,82/4,82 4,49/4,49/4,49	5,40/5,43/5,41 4,84/4,84/4,84 4,45/4,53/4,49	4,42/4,48/4,45
Saldo	15.844,5	16.015,5	15.778,5	16.021,0	15.484,4
Próximo vencimiento de CDBCRP (30 de mayo del 2007)					1.100,0
Vencimientos de CDBCRP del 30 de mayo al 1 de junio del 2007					1.100,0
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	15,9	57,1	66,7	115,9	510,6
i. Compras (millones de US\$)	5,0	18,0	21,0	36,5	161,0
Tipo de cambio promedio	3,1730	3,1739	3,1750	3,1748	3,1713
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	50,0	50,0			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	96,4	39,9	304,4	208,5	1114,6
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	40,0	0,0	101,6	93,5	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	56,4	39,9	202,8	115,0	1.114,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1.729,7	1.719,5	1.715,4	1.708,7	2.508,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,1	7,0	7,0	7,0	63,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	335,8	325,6	321,5	314,8	1114,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,3	1,3	1,3	28,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	65,4	181,1	247,8	191,1	80,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,55/4,49	4,50/4,85/4,61	4,50/4,55/4,51	4,50/4,55/4,51	4,50/4,50/4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0	9,0	4,0	15,0	1,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP	9,0	44,4	137,3	52,0	67,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		5,5/5,12			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)			0,4/5,52	22,0/5,40	1,0/5,42
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	25 Mayo	28 Mayo	29 Mayo	30 Mayo	31 Mayo
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-6,0	42,2	45,6	-6,3	-38,0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-67,5	18,2	-50,7	-5,5	-7,3
a. Mercado spot con el público	58,1	31,6	-42,3	17,5	40,6
i. Compras	142,8	101,2	228,6	158,4	176,8
ii. (-) Ventas	84,7	69,6	270,9	141,0	136,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	46,2	19,7	73,8	49,4	-59,4
i. Pactadas	75,3	35,0	245,6	92,5	174,8
ii. (-) Vencidas	29,1	15,3	171,9	43,0	234,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-15,4	-4,2	-22,5	50,3	-28,7
i. Pactadas	21,2	4,5	48,2	91,1	42,1
ii. (-) Vencidas	36,6	8,7	70,7	40,8	70,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	77,5	84,4	168,0	121,0	116,2
ii. A futuro	32,0	10,0	30,0	50,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	8,0	-15,3	-93,3	2,4	-171,6
i. Compras	30,0	0,0	67,0	37,4	60,7
ii. (-) Ventas	22,0	15,3	160,3	35,0	232,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-126,2	-4,6	-16,2	-27,5	-39,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,170	3,173	3,173	3,176	3,175