

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

	23 Abril	24 Abril	25 Abril	26 Abril	27 Abril
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	261,2	105,0	90,4	160,4	333,8
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	50,0	75,0	60,0	60,0	60,0
Plazo de vencimiento	138,0	229,0	105,0	218,5	180,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	122,2	265,0	131,0	131,0	307,0
Saldo	249,0	4,41/4,45/4,45	4,38/4,38/4,38	2 años	3 años
Próximo vencimiento de CDBCRP (25 de abril del 2007)	5,48/5,51/5,50	5,33/5,42/5,40	5,51/5,52/5,51	5,40/5,42/5,41	5,48/5,53/5,51
Vencimientos de CDBCRP del 25 al 27 de abril del 2007	11 793,4	11 553,4	11 328,4	11 208,5	11 548,5
ii. Subasta de compra temporal de valores					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDRBCRP					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable 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	158,9	317,6	317,5	285,6	253,7
i. Compras (millones de US\$)	50,0	100,0	100,0	90,0	80,0
Tipo de cambio promedio	3,1780	3,1762	3,1754	3,1730	3,1710
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					100,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	180,1	222,6	308,0	446,0	307,5
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%	0,0058%
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	20,4	61,6	191,2	398,2	267,0
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	159,7	161,0	116,8	47,8	40,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 994,0	1 983,5	1 972,0	1 958,8	1 946,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,1	8,1	8,0	8,0	8,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	413,3	402,8	391,3	378,1	365,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,6	1,6	1,5	1,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	129,6	185,5	494,0	602,5	225,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,50/4,49	4,50/4,50/4,50	4,40/4,55/4,49	4,45/4,60/4,51	4,45/4,50/4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	29,0	53,0	41,0	7,0	3,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,55/5,55/5,55	5,55/5,60/5,55	5,55/5,55/5,55	5,60/5,60/5,60	5,60/5,75/5,63
c. Total mercado secundario de CDBCRP	21,0	153,1	93,5	235,0	30,6
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\$)	20 Abril	23 Abril	24 Abril	25 Abril	26 Abril
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	10,7	-26,6	-49,2	27,5	-30,8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	36,1	-73,2	-71,5	-93,4	-60,1
a. Mercado spot con el público	73,6	-27,5	40,5	2,2	40,3
i. Compras	184,6	169,4	170,9	120,2	177,5
ii. (-) Ventas	111,0	196,9	130,5	118,1	137,2
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-99,0	7,6	32,0	235,2	-55,1
i. Pactadas	97,7	88,9	57,0	253,8	110,2
ii. (-) Vencidas	196,7	81,3	25,0	18,6	165,4
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-73,6	-38,9	9,8	114,3	-84,4
i. Pactadas	40,4	27,1	40,4	120,3	40,3
ii. (-) Vencidas	113,9	66,0	30,6	6,0	124,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	121,5	111,5	159,0	85,0	77,0
ii. A futuro	25,0	10,0	10,0	68,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-106,5	-10,9	-2,1	-8,0	-54,2
i. Compras	86,5	64,2	18,1	5,0	110,2
ii. (-) Ventas	193,0	75,1	20,2	13,0	164,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-13,8	-50,0	-104,2	-100,2	-86,9
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,178	3,178	3,176	3,175	3,173