

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

	29 Mayo	30 Mayo	31 Mayo	1 Junio	2 Junio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-85,9	-32,6	-113,5	-246,2	-184,6
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)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	4 436,1	4 436,1	4 436,1	4 436,1	4 436,1
Próximo vencimiento de CDBCRP (8 de junio de 2006)			290,0	290,0	290,0
Vencimientos de CDBCRP del 31 de mayo al 2 de junio de 2006			0,0	290,0	290,0
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP, CDRBCRP y de BTP	<u>100,0</u> <u>105,0</u>	<u>165,0</u> <u>50,0</u>	<u>150,0</u> <u>40,0</u> <u>55,0</u>	<u>400,0</u> <u>685,0</u> <u>300,0</u> <u>30,0</u>	<u>50,0</u> <u>250,0</u> <u>700,0</u>
Propuestas recibidas	102,7	105,0	325,0	750,0	80,0
Plazo de vencimiento	1 mes 1 día	1 día 1 día	1 día 1 día 1 día	1 mes 1 día 1 día 1 día	3 meses 1 mes 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,77/4,77/4,77	4,52/4,57/4,56	4,61/4,61/4,61	4,81/4,68/4,65	4,73/5,01/4,95
Saldo	2 224,8	2 334,8	2 364,8	3 234,8	2 919,8
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDRBCRP)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	1 196,6	1 196,6	1 196,6	1 196,6	1 196,6
Próximo vencimiento de CDRBCRP (12 de junio de 2006)	239,0	239,0	239,0	239,0	239,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	119,1	182,4	131,5	1 168,8	815,4
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)	0,0077%	0,0076%	0,0076%	0,0077%	0,0077%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (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	8,5	110,0	63,6	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	110,6	72,4	67,9	1 168,8	815,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 318,9	1 312,9	1 307,1	2 233,7	2 073,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	7,0	7,0	13,4	11,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	254,0	248,0	242,2	1 168,8	992,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,3	1,3	7,0	5,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>117,2</u>	<u>357,0</u>	<u>242,0</u>	<u>28,0</u>	<u>25,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/4,60/4,55	4,50/4,60/4,56	4,50/4,65/4,58	4,70/4,75/4,73	4,40/4,50/4,48
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>20,0</u>	<u>20,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>11,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,90/4,90/4,90	4,90/4,90/4,90			4,78/4,78/4,78
c. Total mercado secundario de CDBCRP	<u>0,0</u>	<u>7,3</u>	<u>7,7</u>	<u>4,7</u>	<u>0,0</u>
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\$)	26 Mayo	29 Mayo	30 Mayo	31 Mayo	1 Junio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	38,2	2,5	-25,7	18,7	-15,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	7,0	-12,8	-18,2	37,6	-51,0
a. Mercado spot con el público	<u>38,0</u>	<u>18,8</u>	<u>-5,2</u>	<u>23,3</u>	<u>-18,7</u>
i. Compras	155,2	76,0	75,3	103,1	102,8
ii. (-) Ventas	117,2	57,2	80,5	79,8	121,5
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	<u>14,1</u>	<u>38,1</u>	<u>21,9</u>	<u>65,7</u>	<u>1,2</u>
i. Pactadas	25,7	52,5	32,1	86,1	64,9
ii. (-) Vencidas	11,6	14,5	10,2	20,3	63,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<u>-17,1</u>	<u>22,8</u>	<u>29,4</u>	<u>84,6</u>	<u>-34,6</u>
i. Pactadas	80,2	93,6	104,0	142,3	119,5
ii. (-) Vencidas	97,3	70,7	74,6	57,8	154,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	90,5	43,0	82,5	91,5	127,0
ii. A futuro	13,0	5,0	2,0	10,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<u>58,1</u>	<u>34,7</u>	<u>32,4</u>	<u>37,2</u>	<u>82,0</u>
i. Compras	69,1	49,0	42,4	57,2	144,0
ii. (-) Ventas	11,0	14,3	10,0	20,0	62,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>-3,5</u>	<u>-10,0</u>	<u>19,0</u>	<u>14,5</u>	<u>-24,0</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,272	3,289	3,299	3,292	
(*) Datos preliminares					