

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

| | 4 Setiembre | 5 Setiembre | 6 Setiembre | 7 Setiembre | 8 Setiembre |
|--|----------------------------------|--|----------------------------------|---------------------------|--|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 647,6 | 889,2 | 562,9 | 511,7 | 697,7 |
| 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>49,9</u> <u>50,0</u> | <u>30,0</u> <u>32,2</u> <u>100,0</u> <u>200,0</u> <u>100,0</u> | <u>163,0</u> <u>3,0</u> | <u>45,0</u> | <u>49,9</u> <u>50,0</u> <u>100,0</u> <u>50,0</u> |
| Propuestas recibidas | 140,0 54,0 | 58,0 121,2 116,0 219,0 100,0 | 163,0 3,0 | 45,0 | 102,0 97,0 244,0 114,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 año 1 semana | 2 años 9 meses 1 mes 1 semana 1 semana | 1 semana 1 semana | 1 día | 6 meses 1 semana 3 días 3 días |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5,39/5,45/5,42 4,60/4,60/4,60 | 5,85/5,95/5,90 5,24/5,44/5,37 4,73/4,80/4,80 5,188,8 | 4,55/4,55/4,55 4,49/4,49/4,49 | 4,53/4,53/4,53 5 429,8 | 5,13/5,23/5,20 4,61/4,63/4,61 4,25/4,39/4,33 4,24/4,32/4,27 |
| Saldo | 4 926,6 | 5 188,8 | 5 384,8 | 5 634,7 | 5 634,7 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (11 de setiembre de 2006) | | | | | 200,0 |
| Vencimientos de CDBCRP del 6 al 8 de setiembre de 2006 | | | | | 806,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de valores | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | 203,8 | 153,8 | 153,8 | 153,8 | 153,8 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDRBCRP) | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | 670,0 | 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 | 270,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 26,0 | 55,1 | 16,2 | 51,9 | 60,1 |
| i. Compras (millones de US\$) | 8,0 | 17,0 | 5,0 | 16,0 | 18,5 |
| Tipo de cambio promedio | 3,2441 | 3,2440 | 3,2441 | 3,2450 | 3,2460 |
| 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 | 573,7 | 512,1 | 383,1 | 518,6 | 507,8 |
| 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% | 0,0078% |
| 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 | 185,0 | 150,0 | 0,0 | 6,8 | 25,0 |
| 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 | 388,7 | 362,1 | 383,1 | 511,8 | 482,8 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 1 980,0 | 1 956,3 | 1 944,1 | 1 953,7 | 1 957,3 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,8 | 9,6 | 9,6 | 9,6 | 9,6 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 480,4 | 456,7 | 444,4 | 454,1 | 457,7 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,4 | 2,2 | 2,2 | 2,2 | 2,2 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 298,5 | 201,0 | 85,0 | 134,0 | 163,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,40/4,55/4,48 | 4,40/4,50/4,44 | 4,40/4,45/4,44 | 4,45/4,50/4,48 | 4,35/4,50/4,43 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 4,4 | 19,7 | 2,7 | 1,7 | 1,7 |
| 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 | 5,25/5,25/5,25 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 37,8 | 11,0 | 22,0 | 18,0 | 51,3 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 13,0/5,14 | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | 7,0/5,47 | 3,0/5,40 | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | 5,0/5,65 | | 2,0/5,85 | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 1 Setiembre | 4 Setiembre | 5 Setiembre | 6 Setiembre | 7 Setiembre |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 27,4 | 5,3 | -21,3 | 42,5 | -14,1 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 18,2 | 4,9 | -36,6 | 37,6 | -7,5 |
| a. Mercado spot con el público | 26,1 | 27,6 | 3,4 | 40,4 | 30,4 |
| i. Compras | 88,2 | 83,5 | 85,7 | 93,4 | 137,4 |
| ii. (-) Ventas | 62,1 | 55,9 | 82,3 | 53,0 | 107,0 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | 0,6 | -4,6 | 63,2 | 10,0 | -35,1 |
| i. Pactadas | 19,0 | 4,1 | 77,1 | 50,2 | 51,5 |
| ii. (-) Vencidas | 18,4 | 8,7 | 13,9 | 40,3 | 86,6 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -8,6 | -5,0 | 47,9 | 5,1 | -28,6 |
| i. Pactadas | 15,3 | 7,4 | 79,3 | 71,2 | 48,4 |
| ii. (-) Vencidas | 23,9 | 12,4 | 31,5 | 66,1 | 76,9 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 48,2 | 26,5 | 39,0 | 35,0 | 43,7 |
| ii. A futuro | 0,0 | 0,0 | 10,5 | 32,0 | 26,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 5,1 | -3,0 | 17,5 | 20,0 | -12,6 |
| i. Compras | 20,1 | 5,5 | 31,0 | 60,0 | 74,0 |
| ii. (-) Ventas | 15,0 | 8,5 | 13,5 | 40,0 | 86,6 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -7,5 | -16,0 | -40,0 | 3,0 | -35,0 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,242 | 3,244 | 3,244 | 3,245 | 3,245 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |