

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

	16 Octubre	17 Octubre	18 Octubre	19 Octubre	20 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	422,9	409,7	790,6	511,4	20,7
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)					0,0
Propuestas recibidas	60,0 86,0	50,0 132,0	50,0 100,0 200,0 300,0	50,0 100,0 100,0 199,9 70,0	
Plazo de vencimiento	130,0 86,0	125,0 132,0	67,0 162,0 345,0 333,0	176,5 173,0 202,0 305,0 76,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6 meses 1 día	6 meses 1 día	1 año 6 meses 1 semana 1 día	1 año 6 meses 1 semana 1 día	
Saldo	5,01/5,05/5,04 4,49/4,53/4,51	5,02/5,02/5,02 4,49/4,53/4,51	5,34/5,50/5,46 5,00/5,00/5,00 4,49/4,55/4,51 4,45/4,53/4,48	5,40/5,47/5,45 4,99/5,00/5,00 4,49/4,53/4,52 4,45/4,49/4,47 4,34/4,49/4,38	
Próximo vencimiento de CDBCRP (18 de octubre de 2006)	5 105,5	5 201,5	5 236,5	5 356,4	
Vencimientos de CDBCRP del 18 al 20 de octubre de 2006					5 086,5
ii. Subasta de compra temporal de valores	0,0	0,0	0,0	0,0	200,0
Propuestas recibidas					300,0
Plazo de vencimiento					0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable 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	146,0	0,0	136,2	129,6	161,9
i. Compras (millones de US\$)	45,0	40,0	42,0	40,0	50,1
Tipo de cambio promedio	3,2441		3,2430	3,2400	3,2316
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			60,0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	422,9	227,7	276,8	121,1	182,6
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)	0,0078%	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	35,5	64,9	55,1	26,2	55,6
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	387,4	162,8	221,7	94,9	127,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 521,4	1 507,4	1 498,2	1 483,2	1 471,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	7,3	7,3	7,2	7,1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	401,8	387,7	378,5	363,6	351,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	1,9	1,8	1,8	1,7
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	97,5	174,0	145,0	208,5	469,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,55/4,50	4,45/4,50/4,47	4,45/4,50/4,48	4,35/4,50/4,47	4,45/4,55/4,51
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	10,0	3,0	5,7	12,0	12,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30	5,30/5,30/5,30
c. Total mercado secundario de CDBCRP	6,5	0,0	16,0	36,0	0,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				15,0/5,00	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 Octubre	16 Octubre	17 Octubre	18 Octubre	19 Octubre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	22,2	-8,1	-20,6	-18,6	22,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	26,6	-33,1	-29,8	28,5	-46,7
a. Mercado spot con el público	40,9	19,0	13,0	28,3	1,2
i. Compras	126,9	99,4	152,1	91,6	142,9
ii. (-) Ventas	86,0	80,5	78,6	123,7	141,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	16,9	-29,8	42,9	61,7	24,6
i. Pactadas	33,9	35,1	129,6	155,2	90,7
ii. (-) Vencidas	17,0	64,9	86,7	93,5	66,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	21,3	-54,8	92,1	50,5	-44,1
i. Pactadas	60,9	16,1	140,6	111,3	11,9
ii. (-) Vencidas	39,6	70,9	48,4	60,7	56,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	59,0	33,5	27,5	67,5	39,0
ii. A futuro	0,0	0,0	6,9	6,0	18,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	17,5	-0,7	-20,0	-36,4	-12,3
i. Compras	32,5	60,0	41,0	53,6	53,4
ii. (-) Ventas	15,0	60,7	61,0	90,0	65,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-9,2	-45,4	-2,7	-54,5	-45,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,246	3,244	3,244	3,244	3,240
(*) Datos preliminares					