

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

| | 23 Octubre | 24 Octubre | 25 Octubre | 26 Octubre | 27 Octubre |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 80,9 | 257,8 | 433,5 | 366,7 | 246,8 |
| 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) | 140,0 | 50,0 | 30,0 | 30,0 | 50,0 |
| Propuestas recibidas | 278,0 | 111,0 | 83,0 | 108,0 | 108,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 semana | 1 día | 1 año | 1 año | 1 semana |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,52/4,56/4,55 | 4,34/4,53/4,49 | 4,98/4,99/4,99 | 4,56/4,56/4,56 | 4,52/4,52/4,52 |
| Saldo | 5 338,5 | 5 506,4 | 5 505,5 | 5 526,5 | 5 576,5 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (25 de octubre de 2006) | | 379,9 | | | 140,0 |
| Vencimientos de CDBCRP del 25 al 27 de octubre de 2006 | | 479,9 | | | 560,0 |
| 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 | 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 | 322,1 | 161,2 | 96,8 | 0,0 | 64,3 |
| i. Compras (millones de US\$) | 100,0 | 50,0 | 30,0 | | 20,0 |
| Tipo de cambio promedio | 3,2210 | 3,2230 | 3,2272 | | 3,2173 |
| 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 | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 151,0 | 139,0 | 151,3 | 166,7 | 261,1 |
| 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 | 3,2 | 52,0 | 111,8 | 194,5 |
| 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 | 115,5 | 135,8 | 99,3 | 54,9 | 66,6 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 1 441,6 | 1 433,8 | 1 425,2 | 1 415,6 | 1 407,1 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,0 | 7,0 | 6,9 | 6,9 | 6,9 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 321,9 | 314,2 | 305,6 | 295,9 | 287,4 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1,6 | 1,5 | 1,5 | 1,4 | 1,4 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 352,8 | 284,0 | 196,0 | 147,1 | 255,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 4,45/4,55/4,51 | 4,45/4,55/4,50 | 4,45/4,55/4,52 | 4,50/4,50/4,50 | 4,45/4,50/4,50 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 5,0 | 5,0 | 5,6 | 6,6 | 0,0 |
| 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 | |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 0,0 | 25,3 | 14,0 | 65,0 | 0,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | 2,0/5,00 | 48,0/4,99 | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | 2,0/5,41 | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 20 Octubre | 23 Octubre | 24 Octubre | 25 Octubre | 26 Octubre |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 21,5 | -43,2 | 6,7 | 15,7 | 22,9 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 3,1 | -130,0 | -46,5 | -84,3 | 12,1 |
| a. Mercado spot con el público | 46,5 | -15,4 | -2,1 | -51,0 | 6,8 |
| i. Compras | 164,5 | 87,5 | 72,3 | 63,4 | 71,1 |
| ii. (-) Ventas | 118,0 | 103,0 | 74,4 | 114,4 | 64,3 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -25,9 | 30,5 | 42,4 | 34,1 | -2,8 |
| i. Pactadas | 84,9 | 99,1 | 88,2 | 88,5 | 19,7 |
| ii. (-) Vencidas | 110,8 | 68,6 | 45,9 | 54,4 | 22,5 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -44,3 | -56,3 | -10,8 | -65,9 | -13,5 |
| i. Pactadas | 41,6 | 52,4 | 29,1 | 50,3 | 13,5 |
| ii. (-) Vencidas | 85,9 | 108,7 | 39,9 | 116,2 | 27,0 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 67,3 | 53,5 | 47,5 | 111,0 | 24,0 |
| ii. A futuro | 23,0 | 15,0 | 17,0 | 15,0 | 16,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -9,1 | 28,2 | -7,0 | 57,5 | 2,3 |
| i. Compras | 85,8 | 96,3 | 36,0 | 109,8 | 23,0 |
| ii. (-) Ventas | 94,9 | 68,1 | 43,0 | 52,3 | 20,7 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -59,1 | -102,7 | -43,4 | -29,0 | 7,5 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,232 | 3,221 | 3,223 | 3,226 | 3,227 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |