

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

	30 Octubre	31 Octubre	2 Noviembre	3 Noviembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	451,9	453,7	784,8	895,6
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)				
Propuestas recibidas	50,0 150,0 150,0 149,9	50,0 100,0 280,0 90,9	75,0 100,0 100,0	30,0 90,0 136,0 50,0 100,0
Plazo de vencimiento	130,0 314,0 185,0 197,1	189,5 181,5 399,0 90,9	192,0 204,0 207,0	141,0 159,0 136,0 54,0 150,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 año 6 meses 1 semana 1 día	1 año 3 meses 2 días 2 días	1 año 6 meses 1 semana	2 años 1 año 6 meses 1 mes 1 semana
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,33/5,34/5,34 4,97/4,97/4,97 4,55/4,56/4,55 4,38/4,49/4,44	5,31/5,31/5,31 4,75/4,80/4,79 4,36/4,45/4,44 4,38/4,45/4,44	5,27/5,27/5,27 5,00/5,07/5,03 4,53/4,53/4,53	5,62/5,62/5,62 5,21/5,27/5,27 5,01/5,12/5,08 4,58/4,58/4,58 4,56/4,56/4,56
Saldo	5 936,4	6 307,4	5 841,5	6 167,5
Próximo vencimiento de CDBCRP (02 de noviembre de 2006)				150,0
Vencimientos de CDBCRP del 02 al 03 de noviembre de 2006				967,0
ii. Subasta de compra temporal de valores	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
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)	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
Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 de diciembre de 2006)	270,0	270,0	270,0	270,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	225,2	225,0	241,0	96,6
i. Compras (millones de US\$)	70,0	70,0	75,0	30,0
Tipo de cambio promedio	3,2167	3,2140	3,2133	3,2184
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	177,2	157,8	750,8	616,2
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%	0,0071%	0,0078%	0,0078%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	93,8	105,5	29,0	27,7
Tasa de interés	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	83,4	52,3	721,8	588,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 385,6	1 378,7	1 506,7	1 573,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,7	7,5	7,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	265,9	259,0	387,1	454,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,3	1,3	1,9	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	152,3	92,4	145,5	207,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/4,50/4,50	4,25/4,50/4,41	4,50/4,50/4,50	4,50/4,50/4,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	5,0	5,0	25,0	23,0
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	13,0	10,5	14,0	7,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	3,0/4,95			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		2,0/5,30		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Octubre	30 Octubre	31 Octubre	2 Noviembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	4,9	-51,0	33,2	-59,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-3,4	-53,6	-53,5	-95,7
a. Mercado spot con el público	26,2	12,1	29,2	-29,7
i. Compras	117,4	148,4	149,5	130,2
ii. (-) Ventas	91,1	136,4	120,3	159,9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	147,9	10,1	-15,8	18,4
i. Pactadas	163,0	83,9	134,2	177,6
ii. (-) Vencidas	15,2	73,8	150,0	159,2
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	139,6	7,4	-102,4	-17,7
i. Pactadas	180,0	37,6	18,2	113,9
ii. (-) Vencidas	40,4	30,2	120,6	131,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	41,0	34,1	71,5	54,5
ii. A futuro	10,0	0,0	5,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	25,5	-40,7	-37,6	-29,8
i. Compras	38,0	21,9	112,4	127,0
ii. (-) Ventas	12,5	62,7	150,0	156,8
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-29,8	-68,6	-74,4	-63,8
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,220	3,216	3,214	3,217
(*) Datos preliminares				