

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

	13 Noviembre						14 Noviembre				15 Noviembre		16 Noviembre		17 Noviembre		
	1 072,9						483,6				624,4		516,0		750,6		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR																	
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	100,0	100,0	150,0	200,0	215,0	15,0	50,0	50,0	100,0	150,0	50,0	250,0	225,1	50,0	200,0	270,0	60,0
Plazo de vencimiento	1 año	9 meses	3 meses	1 semana	1 día	1 día	108,0	85,0	110,5	151,0	41,0	310,0	319,0	80,0	247,0	374,0	84,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,15/5,15/5,15	5,05/5,08/5,07	4,69/4,70/4,69	4,52/4,55/4,53	4,41/4,53/4,49	4,53/4,53/4,53	5,50/5,57/5,53	5,13/5,20/5,18	4,51/4,55/4,52	4,49/4,53/4,50	5,53/5,57/5,54	4,45/4,53/4,52	4,41/4,49/4,42	4,41/4,41/4,41	4,51/4,55/4,55	4,35/4,43/4,38	4,35/4,35/4,35
Saldo																	
Próximo vencimiento de CDBCRP (15 de noviembre de 2006)																	
Vencimientos de CDBCRP del 15 al 17 de noviembre de 2006																	
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	64,4						80,7				0,0		64,5		32,3		
i. Compras (millones de US\$)	20,0						25,0				20,0		10,0		10,0		
Tipo de cambio promedio	3,2199						3,2270						3,2265		3,2264		
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				30,0		30,0		30,0		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	357,3						264,3				324,4		305,4		252,9		
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	58,2						30,1				6,4		28,3		49,2		
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	299,1						234,2				318,0		277,1		203,7		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 505,5						1 494,6				1 490,8		1 485,0		1 475,5		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,3						7,2				7,1		7,1		7,0		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	385,8						375,0				371,2		365,3		355,8		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9						1,8				1,8		1,7		1,7		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																	
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	76,0						106,5				162,2		198,7		157,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,25/4,45/4,43						4,45/4,55/4,50				4,45/4,50/4,49		4,25/4,50/4,47		4,25/4,50/4,40		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	8,0						29,0				3,0		25,0		29,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,35/5,40/5,38						5,35/5,40/5,36				5,35/5,40/5,35		5,30/5,40/5,35		5,35/5,40/5,36		
c. Total mercado secundario de CDBCRP	9,0						7,0				31,8		12,0		41,1		
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	2,0/4,94										4,0/4,95		9,0/5,05		2,4/5,00		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)																	
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)																	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	10 Noviembre						13 Noviembre				14 Noviembre		15 Noviembre		16 Noviembre		
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	3,1						-26,3				49,8		31,6		9,2		
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-6,6						0,9				69,0		24,9		-9,2		
a. Mercado spot con el público	45,9						14,0				56,2		54,2		29,6		
i. Compras	114,3						106,0				165,0		156,1		161,5		
ii. (-) Ventas	68,4						92,0				69,8		101,9		151,9		
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	1,0						-6,5				17,7		3,0		3,0		
i. Pactadas	6,7						29,5				34,4		113,2		113,2		
ii. (-) Vencidas	5,7						36,0				76,6		35,2		110,2		
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-8,7						20,7				36,9		-8,4		-15,4		
i. Pactadas	2,5						26,7				50,5		27,4		96,8		
ii. (-) Vencidas	11,3						5,9				13,7		36,8		112,2		
d. Operaciones cambiarias interbancarias																	
i. Al contado	32,0						27,5				54,0		89,5		65,6		
ii. A futuro	0,0						5,0				13,0		27,0		0,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	1,5						-33,6				-67,2		4,4		-9,3		
i. Compras	7,0						1,0				8,0		28,4		100,0		
ii. (-) Ventas	5,5						34,6				75,2		24,0		109,3		
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-48,5						-9,5				-22,0		-32,0		-27,5		
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																	
Tasa de interés																	
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,218						3,219				3,225		3,231		3,227		
(*) Datos preliminares																	