

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

	4 Junio				5 Junio				6 Junio				7 Junio				8 Junio			
	2,296,4				2,451,3				2,559,1				2,494,1				2,338,9			
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	50,0	50,0	1800,0	50,1	30,0	50,0	50,0	2027,0	30,0	70,0	70,0	2010,0	30,0	100,0	100,0	1900,0	70,0	--	1800,0	
Plazo de vencimiento	1 año	6 meses	1 día	1 día	2 años	1 año	6 meses	1 día	2 años	1 año	6 meses	1 día	3 años	1 año	6 meses	1 día	1 año	6 meses	3 días	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,15/5,18/5,16	4,86/4,88/4,88	4,38/4,53/4,47	4,53/4,53/4,53	5,48/5,50/5,49	5,15/5,16/5,16	4,87/4,87/4,87	4,41/4,53/4,51	5,40/5,45/5,43	5,14/5,14/5,14	4,88/4,88/4,88	4,45/4,53/4,51	5,51/5,52/5,52	5,16/5,16/5,16	4,93/4,95/4,95	4,45/4,53/4,51	5,18/5,25/5,25	--	4,48/4,52/4,52	
Saldo	16.334,5				16.611,4				16.764,4				16.884,4				1.800,0			
Próximo vencimiento de CDBCRP (6 de junio del 2007)																				
Vencimientos de CDBCRP del 6 al 8 junio del 2007																				
ii. Subasta de compra temporal de valores																				
Propuestas recibidas																				
Plazo de vencimiento																				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio																				
Saldo																				
Próximo vencimiento de CDRBCRP																				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	174,4				110,9				31,7				0,0				0,0			
i. Compras (millones de US\$)	55,0				35,0				10,0											
Tipo de cambio promedio	3,1700				3,1698				3,1702											
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	520,6				435,2				410,8				364,1				438,9			
4. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones																				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)																				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0048%				0,0048%				0,0048%				0,0048%				0,0048%			
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	0,0				0,0				0,0				0,0				0,0			
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	520,6				432,2				410,8				364,1				438,9			
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2.270,6				2.159,8				2.085,0				2.025,0				1.989,3			
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,0				8,5				8,1				7,9				7,7			
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	966,1				859,3				784,6				724,5				688,8			
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,8				3,4				3,1				2,8				2,7			
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP																				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	153,0				70,0				107,0				178,0				191,1			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,40/4,50/4,45				4,45/4,50/4,50				4,50/4,50/4,50				4,43/4,50/4,47				4,50/4,55/4,50			
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,0				0,0				0,0				19,0				39,0			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio													6,00/6,00/6,00				6,15/6,15/6,15			
c. Total mercado secundario de CDBCRP	191,7				16,7				59,0				45,8				90,0			
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)																				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)																				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)																	4,0/5,46			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	01 Junio				4 Junio				5 Junio				6 Junio				7 Junio			
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	27,6				-49,6				-12,3				9,9				-38,8			
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-75,2				-2,4				79,0				21,3				113,5			
a. Mercado spot con el público	83,3				31,8				91,2				12,2				86,4			
i. Compras	179,2				108,4				190,7				111,5				225,3			
ii. (-) Ventas	96,0				76,6				99,5				93,3				138,9			
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	113,1				49,2				13,2				-7,5				-174,8			
i. Pactadas	137,8				88,1				107,4				75,0				144,1			
ii. (-) Vencidas	24,7				44,9				94,2				82,5				318,9			
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	10,2				90,4				104,4				3,9				-22,5			
i. Pactadas	32,4				90,5				109,6				67,3				153,3			
ii. (-) Vencidas	22,1				0,1				5,2				63,4				175,8			
d. Operaciones cambiarias interbancarias																				
i. Al contado	176,5				51,5				106,5				132,0				125,0			
ii. A futuro	13,0				13,0				0,0				5,0				19,0			
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-9,1				-33,0				-23,8				-2,0				-121,5			
i. Compras	20,0				0,0				0,9				57,0				173,0			
ii. (-) Ventas	29,1				33,0				74,7				59,0				294,5			
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-161,0				-46,0				-27,5				-7,9				5,5			
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera																				
Tasa de interés																				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,172				3,170				3,169				3,170				3,173			