

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

	13 Agosto	14 Agosto	15 Agosto	16 Agosto	17 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	1 081,3	790,4	538,7	36,3	-524,9
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	50,0 100,0 650,0	50,0 100,0 425,0	350,0		
Plazo de vencimiento	100,0 300,0 716,5	103,0 169,0 474,0	388,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3 meses 1 semana 1 día	3 meses 1 semana 1 día	1 día		
Saldo	5,06/5,15/5,09 4,78/4,78/4,78 4,57/4,72/4,67	5,12/5,14/5,13 4,77/4,78/4,78 4,64/4,72/4,70	4,64/4,75/4,68		
Próximo vencimiento de CDBCRP (15 de agosto del 2007)	14 851,2	14 776,2	14 351,2	14 351,2	14 351,2
Vencimientos de CDBCRP del 15 al 17 de agosto del 2007					
ii. Subasta de compra temporal de valores					
Propuestas recibidas				300,0 200,0 300,0	750,0
Plazo de vencimiento				490,0 397,0 340,0	793,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				1 día 1 día 1 día	3 días
Saldo				4,77/4,81/4,79 4,81/4,83/4,83 4,85/4,88/4,86	4,75/4,81/4,80
Próximo vencimiento de CDRBCRP				800,0	750,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
Propuestas recibidas				300,0 200,0	
Plazo de vencimiento				624,0 435,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				3 meses 3 meses	
Saldo				5,56/5,56/5,56 5,50/5,72/5,56	
Próximo vencimiento de CDRBCRP				500,0	500,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP				500,0	500,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	204,6	0,0	0,0		
i. Compras (millones de US\$)	65,0				
Tipo de cambio promedio	3,1470				
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	100,0	50,0			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	485,9	215,4	188,7	336,3	225,1
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)	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0048%	0,0059%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	118,1	0,0	0,0	0,0	15,0
Tasa de interés	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	367,8	215,4	188,7	336,3	210,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	2 075,4	2 041,5	2 010,3	1 992,2	1 968,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	7,5	7,4	7,4	7,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	690,7	656,7	625,5	607,4	584,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,4	2,3	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	71,3	161,3	228,0	242,0	545,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,65/4,75/4,73	4,75/4,75/4,75	4,75/4,80/4,75	4,75/4,80/4,75	4,75/4,86/4,77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	58,0	105,0	67,0	22,0	5,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,49/5,80/5,70	5,11/5,80/5,69	5,00/5,75/5,44	5,50/5,50/5,50	5,50/5,50/5,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP	5,0	14,0	25,4	0,0	58,7
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	5,0/5,24				
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 Agosto	13 Agosto	14 Agosto	15 Agosto	16 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	62,1	-1,9	32,5	-76,6	-51,2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	47,0	-10,4	38,9	17,8	338,0
a. Mercado spot con el público	108,9	70,5	48,0	17,6	177,1
i. Compras	247,3	172,4	199,3	169,7	263,1
ii. (-) Ventas	138,4	101,9	151,3	152,1	86,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	35,1	-38,2	-96,1	26,6	-123,3
i. Pactadas	47,2	27,4	75,8	100,7	47,7
ii. (-) Vencidas	12,2	65,7	171,9	74,1	171,0
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	20,0	-46,8	-89,7	121,0	265,8
i. Pactadas	86,1	11,4	77,2	192,8	379,5
ii. (-) Vencidas	66,1	58,2	166,9	71,8	113,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	148,0	58,1	125,0	90,7	270,5
ii. A futuro	18,0	10,0	10,0	0,0	39,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0,0	-22,0	-12,5	-9,9	-78,0
i. Compras	10,0	38,3	158,1	62,6	92,0
ii. (-) Ventas	10,0	60,3	170,6	72,5	170,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-8,0	-66,5	-1,6	7,8	181,6
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,153	3,147	3,146	3,144	3,165