

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

	24 Setiembre		25 Setiembre		26 Setiembre		27 Setiembre		28 Setiembre	
	335.5		417.8		342.5		652.0		715.7	
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	Desierta 50.0	Desierta 100.0	50.0	30.0	30.0	140.0	50.0	30.0	50.0	100.0
	Desierta 80.0	Desierta 282.9	101.0	82.0	132.0	332.0	82.0	63.0	269.0	488.3
Plazo de vencimiento	1 año	6 meses	1 día	1 año	3 meses	1 mes	1 día	1 año	6 meses	3 meses
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	--	5,645,765.72	--	4,904,944.92	5,715,770.75	5,256,255.25	5,136,136.19	4,874,874.87	5,725,745.73	5,435,435.43
Saldo										
Próximos vencimientos de CDBCRP (26 de setiembre del 2007)										
Vencimientos de CDBCRP del 26 al 28 de setiembre del 2007										
ii. Subasta de compra temporal de valores										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio										
Saldo										
Próximos vencimientos de CDBCRP (16 de noviembre del 2007)										
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Resizable del BCR (CDBCRP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio										
Saldo	500.0		500.0		500.0		500.0		500.0	
Próximos vencimientos de CDBCRP (16 de noviembre del 2007)										
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR										
i. Compras (millones de US\$)	0.0		0.0		403.6		263.2		185.1	
ii. Ventas (millones de US\$)					130.0		85.0		60.0	
iii. Tipo de cambio promedio					3.1043		3.0965		3.0847	
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	248.5		162.8		226.1		295.2		190.8	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)	0,0049%		0,0049%		0,0049%		0,0049%		0,0060%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	5,75%		5,75%		5,75%		5,75%		5,75%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés	5,75%		5,75%		5,75%		5,75%		5,75%	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional										
Tasa de interés	4,20%		4,20%		4,20%		4,20%		4,20%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	132.3		162.8		163.1		128.6		160.1	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 976.0		1 960.1		1 945.0		1 931.9		1 918.7	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOBE) (*)	7.0		6.9		6.9		6.8		6.8	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	513.8		497.3		482.2		469.1		455.9	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOBE) (*)	1.8		1.8		1.7		1.7		1.6	
6. Mercado interbancario y mercado monetario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	528.0		664.6		633.4		857.6		937.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,905,004,99		4,905,004,98		4,950,004,99		4,750,004,99		4,805,004,98	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	36.0		36.0		6.0		6.0		6.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,005,005,00		4,904,904,90		4,904,904,90		4,904,904,90		4,904,904,93	
c. Total mercado monetario de CDBCRP	564.0		700.6		639.4		863.6		943.0	
Plazo 6 meses (monto) / tasa promedio										
Plazo 12 meses (monto) / tasa promedio										
Plazo 24 meses (monto) / tasa promedio										
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Setiembre		24 Setiembre		25 Setiembre		26 Setiembre		27 Setiembre	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-41.9		53.0		-24.2		-21.6		21.0	
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + f	-84.7		-0.6		-53.5		-122.2		-69.0	
a. Mercado swap con el público	72.8		164.6		28.8		18.4		32.8	
i. Compras	194.1		121.3		94.5		131.4		167.7	
ii. (i) Ventas	122.3		107.0		120.4		112.0		134.9	
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	24.6		22.6		6.7		26.1		131.8	
i. Pastadas	155.0		73.6		64.7		220.0		158.3	
ii. (i) Ventas	60.5		1.0		57.9		134.8		26.4	
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	21.6		19.0		22.6		15.5		43.9	
i. Pastadas	94.2		36.1		55.9		105.9		54.2	
ii. (i) Ventas	42.5		16.1		78.4		121.3		12.3	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	163.1		115.4		115.4		204.6		141.2	
ii. A futuro	10.0		5.0		9.4		34.0		5.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forward sin entrega	-11.4		0.2		6.5		-14.2		-20.0	
i. Compras	36.0		0.0		59.0		116.2		0.0	
ii. (i) Ventas	47.1		0.2		52.5		130.5		21.0	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-153.4		0.0		-135.6		-156.7		-28.9	
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Note: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datarec)	3.113		3.116		3.111		3.106		3.097	