

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

	30 Julio	31 Julio	01 Agosto	2 Agosto	3 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	24,0	121,8	67,7	-153,6	-14,7
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					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	14.335,2	14.335,2	14.335,2	14.335,2	14.335,2
Próximo vencimiento de CDBCRP (7 de agosto del 2007)					284,0
Vencimientos de CDBCRP del 31 de julio al 3 de agosto del 2007					284,0
ii. Subasta de compra temporal de valores	200,0	100,0 100,0	800,1 200,0	1.135,0 200,0	1.185,0
Propuestas recibidas	461,0	235,0 100,0	1637,0 460,0	1.985,0 390,0	1.255,0
Plazo de vencimiento	1 día	1 día 1 día	1 día 1 día	1 día 1 día	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,76/4,81/4,80	4,83/4,83/4,83 4,80/4,80/4,80	4,83/4,87/4,84 4,85/4,87/4,86	4,85/4,93/4,89 4,91/4,91/4,91	4,79/4,87/4,85
Saldo	400,0	400,0	1.200,1	1.335,0	1.185,0
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)					
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
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	224,0	321,8	1.067,8	1.181,4	1.170,3
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	130,0	191,2			22,0
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	94,0	130,6	1.067,8	1.181,4	1.148,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1.836,7	1.826,4	2.452,6	2.509,4	2.517,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,7	56,1	15,5	12,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	452,0	441,6	1.067,8	1.124,6	1.132,5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,6	24,4	6,9	5,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	476,5	404,0	68,0	363,0	245,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,75/4,80/4,76	4,75/4,80/4,75	4,75/4,85/4,79	4,80/4,95/4,87	4,75/4,85/4,83
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	3,0	15,0	5,0	25,0	30,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,50/5,50/5,50	5,00/5,50/5,33	5,90/5,90/5,90	6,00/6,05/6,02	6,00/6,05/6,02
c. Total mercado secundario de CDBCRP	66,2	94,0	44,6	25,0	222,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					10/5,16
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Julio	30 Julio	31 Julio	01 Agosto	2 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-33,2	13,7	-34,5	-98,7	-38,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	14,7	12,4	24,6	-7,2	29,6
a. Mercado spot con el público	-0,4	11,3	26,9	-3,3	25,1
i. Compras	157,9	107,2	148,4	85,7	130,4
ii. (-) Ventas	158,4	95,9	121,5	89,0	105,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-34,2	68,0	24,4	-29,7	-78,8
i. Pactadas	19,3	74,8	91,7	50,4	58,9
ii. (-) Vencidas	53,5	6,7	67,3	80,1	137,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	13,7	66,8	83,4	61,9	-10,8
i. Pactadas	21,5	85,7	156,4	119,3	67,2
ii. (-) Vencidas	7,8	18,9	72,9	57,4	78,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	122,0	139,0	107,5	97,0	137,0
ii. A futuro	10,0	50,0	38,0	0,0	15,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-25,4	14,1	-2,6	-19,0	-63,7
i. Compras	2,0	16,4	61,5	50,0	71,4
ii. (-) Ventas	27,4	2,3	64,0	69,0	135,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5,2	-0,8	5,9	-7,5	8,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,163	3,163	3,161	3,158	3,157