

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

	27 Agosto	28 Agosto	29 Agosto	31 Agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-5,3	38,9	-0,3	90,2
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones				
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>				
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				
Saldo	13 493,2	13 493,2	13 493,2	13 493,2
Próximo vencimiento de CDBCRP (17 de setiembre del 2007)				319,9
Vencimientos de CDBCRP al 31 de agosto del 2007				0,0
ii. <u>Subasta de compra temporal de valores</u>	300,0	240,0	325,0	530,0
Propuestas recibidas	500,0	340,0	505,0	665,0
Plazo de vencimiento	1 día	1 día	2 días	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,79/4,82/4,81	4,85/4,85/4,85	4,78/4,82/4,80	4,75/4,80/4,79
Saldo	300,0	240,0	325,0	530,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				
Saldo	500,0	500,0	500,0	500,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (16 de noviembre del 2007)	500,0	500,0	500,0	500,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	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. <u>Operaciones con el Tesoro Público</u>				
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	294,7	278,9	324,7	620,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0048%	0,0048%	0,0056%	0,0058%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>				
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	100,0	110,0	99,0	366,0
Tasa de interés	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	194,7	168,9	225,7	254,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 839,9	1 829,7	1 822,1	1 809,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,7	6,6	6,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	455,1	444,9	437,3	424,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,6	1,6	1,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	571,3	682,0	623,0	374,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,75/4,82/4,76	4,75/4,85/4,79	4,75/4,82/4,78	4,75/4,80/4,78
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	9,0	9,0	7,0	2,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,05/5,05/5,05	5,05/5,05/5,05	5,36/5,36/5,36	5,36/5,36/5,36
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	184,4	88,1	60,6	63,5
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	22,0/5,17			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	24 Agosto	27 Agosto	28 Agosto	29 Agosto
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-13,8	-14,5	74,1	-14,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-13,6	-68,4	36,0	-11,5
a. <u>Mercado spot con el público</u>	20,2	-34,2	31,3	-6,5
i. Compras	135,2	81,0	122,6	165,8
ii. (-) Ventas	115,1	115,2	91,3	172,3
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-0,7	91,3	7,9	6,7
i. Pactadas	11,8	108,0	82,7	50,5
ii. (-) Vencidas	12,5	16,8	74,9	43,8
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	-0,6	37,4	-30,2	9,8
i. Pactadas	63,9	77,4	57,4	145,2
ii. (-) Vencidas	64,5	40,0	87,6	135,4
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	158,0	53,1	146,2	106,8
ii. A futuro	15,0	3,0	76,0	14,6
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	20,0	5,1	9,9	79,0
i. Compras	32,0	21,1	80,9	121,0
ii. (-) Ventas	12,0	16,0	71,0	42,0
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	-1,9	-16,0	7,6	7,6
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,164	3,163	3,166	3,164