

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

	22 Setiembre	23 Setiembre	24 Setiembre	25 Setiembre	26 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 165,1	2 099,0	3 295,8	2 959,8	2 917,5
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)					
Saldo	11 917,4	11 917,4	11 712,4	11 712,4	--
Próximo vencimiento de CDBCRP (24 de setiembre de 2008)					1 443,0
Vencimientos de CDBCRP del 24 al 26 de setiembre de 2008					0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDBCRP)					
Saldo					
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Saldo	283,0	283,0	--	283,0	--
Próximo vencimiento de Depósitos (29 de diciembre de 2008)			283,0		283,0
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Propuestas recibidas			100,0	50,0	50,0
Plazo de vencimiento			307,6	70,0	105,1
Tasas de interés: Mínima			450,0	574,8	1156,8
Máxima			188,0	171,5	50,4
Promedio			4 m. 1 s. 1 d.	4 m. 1 d.	1 a. 3 d.
Saldo	14 740,4	14 740,4	14 683,6	14 928,4	15 453,7
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (24 de setiembre de 2008)					1 050,1
Vencimientos de CDBCRP-NR del 24 al 26 de setiembre de 2008					1 357,7
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	2165,1	2099,0	2438,2	2265,0	1817,4
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)	0,0119%	0,0119%	0,0119%	0,0119%	0,0118%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	114,3	190,7	141,0	9,0	39,0
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 050,8	1 908,3	2 297,2	2 256,0	1 778,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	5 078,7	5 018,2	4 978,9	4 941,1	4 887,9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,9	11,7	11,6	11,5	11,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	3 300,1	3 239,6	3 200,4	3 162,6	3 109,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	7,6	7,5	7,4	7,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	691,6	623,9	573,0	336,0	204,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,45/6,50/6,50	6,45/6,50/6,50	6,30/6,55/6,49	6,45/6,55/6,50	6,45/6,55/6,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2,6	17,9	5,4	15,9	108,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,00/2,00	1,70/2,00/1,93	1,50/1,50/1,50	1,50/2,00/1,88	1,60/2,45/2,24
c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	778,0	594,1	123,5	214,2	171,9
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\$)	18 Setiembre	22 Setiembre	23 Setiembre	24 Setiembre	25 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-40,5	-31,8	62,9	-21,3	-51,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	166,6	-139,6	62,7	-103,2	5,6
a. Mercado spot con el público	44,2	-114,7	86,9	-28,3	-5,6
i. Compras	234,0	96,5	240,1	146,2	130,6
ii. (-) Ventas	189,8	211,2	153,2	174,5	136,1
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-160,2	95,2	-28,4	51,0	-164,4
i. Pactadas	18,4	136,5	112,2	211,2	122,1
ii. (-) Vencidas	178,6	41,3	140,5	160,2	286,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	46,9	-12,6	-28,6	-31,0	-107,0
i. Pactadas	231,8	50,6	149,9	276,0	106,2
ii. (-) Vencidas	184,9	63,2	178,5	307,0	213,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	315,2	274,4	222,9	222,9	244,2
ii. A futuro	10,0	48,0	81,0	177,0	63,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	8,7	0,0	3,7	71,9	-62,0
i. Compras	184,4	40,0	143,4	194,4	212,2
ii. (-) Ventas	175,7	40,0	139,7	122,5	274,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	120,0	-3,0	10,0	0,0	0,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9728	2,9422	2,9472	2,9603	2,9598
(*) Datos preliminares					