

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ					
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS					
(Millones S/.)					
	18 Setiembre	19 Setiembre	20 Setiembre	21 Setiembre	22 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	360,7	619,7	355,2	160,5	78,8
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)	<u>80,0</u> <u>100,0</u>	<u>70,0</u> <u>200,0</u>	<u>50,0</u> <u>100,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas	179,5 205,0	102,0 410,0	72,0 108,0		
Plazo de vencimiento	1 mes 1 día	1 mes 1 día	1 mes 1 día		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,72/4,73/4,73 4,38/4,38/4,38	4,70/4,70/4,70 4,34/4,34/4,34	4,70/4,70/4,70 4,45/4,45/4,45		
Saldo	5 304,6	5 174,6	5 124,6	5 024,6	4 924,6
Próximo vencimiento de CDBCRP (20 de setiembre de 2006)					385,1
Vencimientos de CDBCRP del 20 al 22 de setiembre de 2006					385,1
ii. Subasta de compra temporal de valores	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>50,0</u>	<u>85,0</u>
Propuestas recibidas				52,0	90,0
Plazo de vencimiento				1 día	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				4,47/4,47/4,47	4,45/4,47/4,45
Saldo	153,8	153,8	153,8	203,8	238,8
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	670,0	670,0	670,0	670,0	670,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (13 de diciembre de 2006)	270,0	270,0	270,0	270,0	270,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>22,7</u>	<u>4,9</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)	7,0	1,5			
Tipo de cambio promedio	3,2450	3,2457			
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	203,4	354,6	205,2	210,5	163,8
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)	0,0078%	0,0078%	0,0078%	0,0077%	0,0077%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<u>89,0</u>	<u>190,0</u>	<u>89,0</u>	<u>101,0</u>	<u>77,5</u>
Tasa de interés	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	114,4	164,6	116,2	109,5	86,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 859,6	1 849,3	1 837,6	1 826,7	1 815,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,0	9,0	8,9	8,9	8,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	359,9	349,6	338,0	327,1	316,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,6	1,6	1,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>187,5</u>	<u>380,2</u>	<u>307,2</u>	<u>169,0</u>	<u>267,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,45/4,55/4,50	4,40/4,50/4,47	4,30/4,55/4,50	4,55/4,55/4,55	4,35/4,55/4,49
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>51,0</u>	<u>60,0</u>	<u>29,2</u>	<u>34,0</u>	<u>34,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,05/5,25/5,19	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,30	5,25/5,25/5,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP	<u>34,0</u>	<u>47,4</u>	<u>16,0</u>	<u>18,5</u>	<u>55,0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				3,5/5,15	2,0/5,55
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	15 Setiembre	18 Setiembre	19 Setiembre	20 Setiembre	21 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-27,9	35,2	-15,4	6,4	-38,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-54,6	24,7	-64,4	7,1	-32,4
a. Mercado spot con el público	<u>49,1</u>	<u>32,4</u>	<u>3,3</u>	<u>18,8</u>	<u>11,7</u>
i. Compras	167,6	153,4	78,1	89,7	122,3
ii. (-) Ventas	118,5	121,1	74,8	70,9	110,6
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	<u>0,7</u>	<u>-9,4</u>	<u>-34,1</u>	<u>56,8</u>	<u>-57,5</u>
i. Pactadas	64,8	88,6	43,9	73,0	56,8
ii. (-) Vencidas	64,1	98,0	78,0	16,2	114,3
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<u>-25,9</u>	<u>-19,9</u>	<u>-83,1</u>	<u>57,4</u>	<u>-51,8</u>
i. Pactadas	43,2	85,9	59,0	89,1	66,8
ii. (-) Vencidas	69,2	105,8	142,0	31,6	118,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	139,5	79,3	35,7	38,0	120,5
ii. A futuro	10,0	10,0	25,0	15,0	5,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	<u>-27,6</u>	<u>10,1</u>	<u>-2,1</u>	<u>15,5</u>	<u>-16,3</u>
i. Compras	31,5	57,2	75,9	31,0	98,0
ii. (-) Ventas	59,1	47,1	78,0	15,5	114,3
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>-71,0</u>	<u>-10,0</u>	<u>-1,5</u>	<u>-11,8</u>	<u>-23,5</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,245	3,246	3,245	3,246	3,248
(*) Datos preliminares					