

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

	4 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre	8 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	647,6	889,2	562,9	511,7	697,7
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)	<u>49,9</u> <u>50,0</u>	<u>30,0</u> <u>32,2</u> <u>100,0</u> <u>200,0</u> <u>100,0</u>	<u>163,0</u> <u>3,0</u>	<u>45,0</u>	<u>49,9</u> <u>50,0</u> <u>100,0</u> <u>50,0</u>
Propuestas recibidas	140,0 54,0	58,0 121,2 116,0 219,0 100,0	163,0 3,0	45,0	102,0 97,0 244,0 114,0
Plazo de vencimiento	1 año 1 semana	2 años 9 meses 1 mes 1 semana 1 semana	1 semana 1 semana	1 día	6 meses 1 semana 3 días 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,39/5,45/5,42 4,60/4,60/4,60	5,85/5,95/5,90 5,24/5,44/5,37 4,73/4,80/4,80 5,188,8	4,55/4,55/4,55 4,49/4,49/4,49	4,53/4,53/4,53 5 429,8	5,13/5,23/5,20 4,61/4,63/4,61 4,25/4,39/4,33 4,24/4,32/4,27
Saldo	4 926,6	5 188,8	5 384,8	5 634,7	5 634,7
Próximo vencimiento de CDBCRP (11 de setiembre de 2006)					200,0
Vencimientos de CDBCRP del 6 al 8 de setiembre de 2006					806,0
ii. Subasta de compra temporal de valores	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo	203,8	153,8	153,8	153,8	153,8
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	26,0	55,1	16,2	51,9	60,1
i. Compras (millones de US\$)	8,0	17,0	5,0	16,0	18,5
Tipo de cambio promedio	3,2441	3,2440	3,2441	3,2450	3,2460
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	573,7	512,1	383,1	518,6	507,8
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%	0,0078%	0,0078%
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	185,0	150,0	0,0	6,8	25,0
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	388,7	362,1	383,1	511,8	482,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 980,0	1 956,3	1 944,1	1 953,7	1 957,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,8	9,6	9,6	9,6	9,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	480,4	456,7	444,4	454,1	457,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,2	2,2	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	298,5	201,0	85,0	134,0	163,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,40/4,55/4,48	4,40/4,50/4,44	4,40/4,45/4,44	4,45/4,50/4,48	4,35/4,50/4,43
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,4	19,7	2,7	1,7	1,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25	5,25/5,25/5,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP	37,8	11,0	22,0	18,0	51,3
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	13,0/5,14				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	7,0/5,47	3,0/5,40			
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	5,0/5,65		2,0/5,85		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	1 Setiembre	4 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	27,4	5,3	-21,3	42,5	-14,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	18,2	4,9	-36,6	37,6	-7,5
a. Mercado spot con el público	26,1	27,6	3,4	40,4	30,4
i. Compras	88,2	83,5	85,7	93,4	137,4
ii. (-) Ventas	62,1	55,9	82,3	53,0	107,0
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	0,6	-4,6	63,2	10,0	-35,1
i. Pactadas	19,0	4,1	77,1	50,2	51,5
ii. (-) Vencidas	18,4	8,7	13,9	40,3	86,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-8,6	-5,0	47,9	5,1	-28,6
i. Pactadas	15,3	7,4	79,3	71,2	48,4
ii. (-) Vencidas	23,9	12,4	31,5	66,1	76,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	48,2	26,5	39,0	35,0	43,7
ii. A futuro	0,0	0,0	10,5	32,0	26,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	5,1	-3,0	17,5	20,0	-12,6
i. Compras	20,1	5,5	31,0	60,0	74,0
ii. (-) Ventas	15,0	8,5	13,5	40,0	86,6
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-7,5	-16,0	-40,0	3,0	-35,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,242	3,244	3,244	3,245	3,245
(*) Datos preliminares					