

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

	25 Setiembre	26 Setiembre	27 Setiembre	28 Setiembre	29 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	367,2	198,5	132,2	93,5	68,5
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	30,0 146,0	0,0	60,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	159,0 146,0		72,0		
	1 año 1 semana		1 semana		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,40/5,49/5,44 4,60/4,61/4,60		4,49/4,58/4,58		
Saldo	4 715,5	4 715,5	4 775,5	4 775,5	4 775,5
Próximo vencimiento de CDBCRP (2 de Octubre de 2006)			146,0		146,0
Vencimientos de CDBCRP del 26 al 29 de setiembre de 2006			0,0		206,0
ii. <u>Subasta de compra temporal de valores</u>	0,0	0,0	0,0	50,0	75,0 35,0
Propuestas recibidas				100,0	112,5 80,0
Plazo de vencimiento				1 día	3 días 3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio				4,53/4,61/4,56	4,55/4,66/4,57 4,55/4,60/4,56
Saldo	153,8	153,8	153,8	203,8	263,8
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDRBCRP)</u>	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. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	0,0	0,0	0,0	0,0	61,7
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					19,0
Tipo de cambio promedio					3,2495
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	191,2	198,5	72,2	143,5	240,2
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)	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%	0,0077%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	14,0	83,0	39,5	90,0	197,5
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	177,2	115,5	32,7	53,5	42,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 522,3	1 515,5	1 486,0	1 478,3	1 472,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4	7,4	7,2	7,2	7,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	292,2	285,4	276,0	268,1	260,3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,4	1,3	1,3	1,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	245,0	141,5	313,0	338,0	399,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,50/4,55/4,55	4,40/4,55/4,51	4,50/4,60/4,55	4,45/4,60/4,55	4,60/4,60/4,60
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	37,4	39,0	34,0	33,0	0,0
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	
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	16,0	12,0	90,3	2,0	3,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				2,0/5,03	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	7,0/5,70	10,0/5,55	30,3/5,55		3,0/5,45
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	22 Setiembre	25 Setiembre	26 Setiembre	27 Setiembre	28 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	20,7	-10,6	-25,0	19,1	-19,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	50,0	9,3	-19,8	35,3	-11,6
a. <u>Mercado spot con el público</u>	32,2	11,0	-22,4	12,0	-12,7
i. <u>Compras</u>	103,0	91,5	53,8	143,9	119,5
ii. (-) <u>Ventas</u>	70,8	80,5	76,2	131,9	132,2
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	-29,2	13,6	4,6	-101,5	-25,8
i. <u>Pactadas</u>	47,1	18,4	63,0	13,7	41,6
ii. (-) <u>Vencidas</u>	76,2	4,8	58,4	115,3	67,4
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	0,1	33,5	9,8	-85,3	-18,1
i. <u>Pactadas</u>	60,3	60,1	54,0	64,0	32,8
ii. (-) <u>Vencidas</u>	60,1	26,6	44,2	149,3	50,9
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. <u>Al contado</u>	41,4	41,5	28,0	121,0	51,0
ii. <u>A futuro</u>	5,0	4,0	4,0	15,0	24,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	-18,3	-0,9	-15,2	34,8	-21,8
i. <u>Compras</u>	57,8	3,8	42,3	149,0	45,5
ii. (-) <u>Ventas</u>	76,1	4,7	57,4	114,3	67,3
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	20,0	21,0	3,5	22,5	6,5
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,250	3,251	3,249	3,251	3,253
(*) Datos preliminares					