

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

	3 Setiembre	4 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre	7 Setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	-114,2	23,0	21,9	146,3	238,0
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	13 493,2
Próximo vencimiento de CDBCRP (17 de setiembre del 2007)					319,9
Vencimientos de CDBCRP del 05 al 07 de setiembre del 2007					
ii. <u>Subasta de compra temporal de valores</u>	<u>1 100,0</u>	<u>820,0</u>	<u>800,1</u>	<u>700,0</u>	<u>700,0</u>
Propuestas recibidas	1 265,0	1 309,5	1 319,5	1 194,5	1 070,0
Plazo de vencimiento	1 día	1 día	1 día	1 día	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,74/4,80/4,76	4,77/4,82/4,79	4,78/4,82/4,79	4,81/4,83/4,82	5,03/5,05/5,04
Saldo	1 100,0	820,0	800,1	700,0	700,0
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	500,0
Próximo vencimiento de CDRBCRP (16 de noviembre del 2007)	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>					
Tipo de cambio promedio					
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público</u>					
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>					
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>		6,3			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	985,8	843,0	822,0	846,3	938,0
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%	0,0048%	0,0048%	0,0058%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,75%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>59,8</u>
Tasa de interés	4,00%	4,00%	4,00%	4,00%	4,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	985,8	843,0	822,0	846,3	878,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 882,8	1 969,1	2 016,6	2 052,3	2 082,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	9,2	7,0	7,3	7,3	7,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	498,1	584,3	631,8	667,6	697,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,1	2,3	2,4	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>50,0</u>	<u>202,0</u>	<u>140,5</u>	<u>216,0</u>	<u>289,8</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4,75/4,75/4,75	4,75/4,75/4,75	4,75/4,75/4,75	4,75/4,82/4,77	5,00/5,00/5,00
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>	<u>44,0</u>	<u>95,5</u>	<u>36,4</u>	<u>94,8</u>	<u>35,0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		7,5/5,29		10,0/5,28	3,0/5,28
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 Agosto	3 Setiembre	4 Setiembre	5 Setiembre	6 Setiembre
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-30,6	25,4	-16,6	11,8	-48,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	13,3	27,8	5,5	27,3	4,5
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>25,8</u>	<u>34,4</u>	<u>13,5</u>	<u>28,4</u>	<u>9,0</u>
i. Compras	148,2	111,4	99,3	96,4	145,5
ii. (-) Ventas	122,4	77,0	85,9	67,9	136,5
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-74,2</u>	<u>-2,2</u>	<u>5,1</u>	<u>8,1</u>	<u>-111,0</u>
i. Pactadas	57,3	2,9	83,2	30,9	172,7
ii. (-) Vencidas	131,6	5,1	78,1	22,8	283,7
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-30,3</u>	<u>0,2</u>	<u>27,2</u>	<u>23,6</u>	<u>-57,9</u>
i. Pactadas	89,0	14,9	82,5	38,6	85,1
ii. (-) Vencidas	119,3	14,7	55,3	15,0	143,0
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	288,7	60,0	105,2	63,0	141,3
ii. A futuro	102,0	0,0	8,0	11,0	10,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-4,1</u>	<u>6,4</u>	<u>-28,9</u>	<u>-13,0</u>	<u>-142,5</u>
i. Compras	81,2	6,4	47,2	8,0	136,0
ii. (-) Ventas	85,3	0,0	76,1	21,0	278,5
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>					
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>	<u>-20,7</u>	<u>-3,4</u>	<u>-1,9</u>	<u>4,1</u>	<u>-2,7</u>
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,162	3,162	3,162	3,165	3,165