

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

	01 Octubre	02 Octubre	03 Octubre	04 Octubre	05 Octubre					
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	841,2	1 615,0	2 071,6	2 356,6	3 245,3					
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)			900,0	1 145,0	100,0	200,0	200,0	300,0	2200,0	304,0
Propuestas recibidas			931,0	1 145,0	122,0	257,0	305,0	927,0	2851,0	304,0
Plazo de vencimiento			1 día	1 día	1 año	6 meses	3 meses	1 mes	4 días	4 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			4,83/4,94/4,90	4,90/5,02/4,97	5,71/5,74/5,73	5,50/5,55/5,53	5,29/5,32/5,31	5,10/5,10/5,10	4,50/4,95/4,85	4,80/4,95/4,90
Saldo	14 153,3	14 153,3	15 053,3	15 298,3	17 457,3					
Próximo vencimiento de CDBCRP (18 de octubre del 2007)					2 504,0					
Vencimientos de CDBCRP del 03 al 05 de octubre del 2007					2 504,0					
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 (CDRBCRP)										
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. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	795,9	592,0	215,1	601,1	528,4					
i. Compras (millones de US\$)	260,0	195,0	71,0	199,0	175,0					
Tipo de cambio promedio	3,0612	3,0361	3,0290	3,0205	3,0195					
ii. Ventas (millones de US\$)										
Tipo de cambio promedio										
c. Operaciones con el Tesoro Público										
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	1637,1	2207,0	1 386,7	1 812,7	469,7					
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)	0,0049%	0,0050%	0,0050%	0,0050%	0,0063%					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0,0	99,0	8,2	182,0	199,0					
Tasa de interés	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%					
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 637,1	2 108,0	1 378,5	1 630,7	270,7					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	3 099,9	3 335,4	3 037,4	3 018,1	2 757,5					
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,7	12,0	10,9	10,8	9,8					
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	1637,1	1872,6	1707,9	1688,6	1405,0					
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,6	6,7	6,1	6,0	5,0					
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	236,0	384,0	206,0	346,0	516,2					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,00/5,05/5,02	4,80/5,05/5,00	4,85/5,00/4,99	4,80/5,00/4,91	4,75/4,95/4,92					
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	0,7	17,0	27,0	11,0	13,0					
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,95/4,95/4,95	5,00/6,00/5,68	5,70/6,00/5,82	5,90/6,00/5,95	6,00/6,00/6,00					
c. Total mercado secundario de CDBCRP	6,5	2,0	20,1	83,0	134,1					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					5,7/5,79					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)										
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Setiembre	1 Octubre	02 Octubre	03 Octubre	04 Octubre					
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	-3,0	-6,8	12,0	10,5	-11,8					
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	-46,0	-145,1	-91,9	33,6	-95,1					
a. Mercado spot con el público	40,4	109,6	97,9	78,7	125,0					
i. Compras	178,0	217,6	223,7	157,8	329,6					
ii. (-) Ventas	137,6	108,1	125,8	79,2	204,6					
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	17,1	168,0	132,5	45,5	112,2					
i. Pactadas	73,7	193,7	216,1	69,1	210,9					
ii. (-) Vencidas	56,6	25,8	83,6	23,6	98,7					
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	-25,8	29,7	28,6	68,5	28,9					
i. Pactadas	62,2	52,3	116,0	104,8	153,6					
ii. (-) Vencidas	88,1	22,6	87,4	36,3	124,7					
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	116,3	243,3	210,3	168,3	166,2					
ii. A futuro	5,0	98,5	35,0	25,0	15,0					
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	10,8	-10,3	-0,9	9,8	17,3					
i. Compras	64,2	10,0	68,1	28,0	112,9					
ii. (-) Ventas	53,4	20,3	69,0	18,2	95,6					
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-65,8	-247,6	-185,1	-42,3	-211,4					
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,085	3,062	3,039	3,027	3,020					