

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

| | 30 Junio | 01 Julio | 02 Julio | 03 Julio | 04 Julio |
|--|-----------------|----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 2 873,7 | 3 207,3 | 3 115,8 | 5 437,6 | 5 461,4 |
| 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> | -- | -- | | | -- |
| Saldo | 14 652,5 | 14 652,5 | 14 652,5 | 12 877,5 | 12 877,5 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (03 de julio de 2008) | | | | | 960,1 |
| Vencimientos de CDBCRP del 02 al 04 de julio del 2008 | | | | | 0,0 |
| ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores</u> | | 1000,0 1600,0 1000,0 | 3700,0 275,0 | 1000,0 550,0 | 1000,0 1000,0 |
| Propuestas recibidas | 3533,0 | 3263,0 | 1000,0 | 4092,0 | 610,0 |
| Plazo de vencimiento | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. | 1 d. |
| Tasas de interés: Mínima | 5,93 | 6,40 | 6,60 | 5,75 | 5,75 |
| Máxima | 6,15 | 6,53 | 6,71 | 5,96 | 5,78 |
| Promedio | 6,09 | 6,48 | 6,68 | 5,84 | 5,76 |
| Saldo | | 3 600,0 | 3 975,0 | 5,86 | 6,02 |
| Saldo | | | | | |
| iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDRBCRP)</u> | | | | | 2 000,0 |
| Saldo | -- | -- | | | -- |
| Próximo vencimiento de Depósitos (29 de diciembre de 2008) | 283,0 | 283,0 | 283,0 | 283,0 | 283,0 |
| v. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</u> | 400,0 | | | | |
| Propuestas recibidas | 729,1 | | | | |
| Plazo de vencimiento | 1 d. | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | 5,51 | | | | |
| Máxima | 5,70 | | | | |
| Promedio | 5,58 | | | | |
| Saldo | 20 007,0 | 19 607,0 | 19 607,0 | 19 330,0 | 19 330,0 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (02 de julio de 2008) | 400,0 | | | | 1 157,0 |
| Vencimientos de CDBCRP-NR del 02 al 04 de julio del 2008 | 677,0 | | | | 0,0 |
| b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u> | 0,0 | -340,8 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. <u>Compras (millones de US\$)</u> | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u> | | 115,0 | | | |
| Tipo de cambio promedio | | 2,9636 | | | |
| 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> | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 2 473,7 | 6 466,5 | 7 090,8 | 6 987,6 | 7 461,4 |
| 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) | 0,0119% | 0,0119% | 0,0119% | 0,0121% | 0,0133% |
| b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u> | | | | | |
| Tasa de interés | 6,50% | 6,50% | 6,50% | 6,50% | 6,50% |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u> | | | | | |
| Tasa de interés | 6,50% | 6,50% | 6,50% | 6,50% | 6,50% |
| d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u> | 458,8 | 76,9 | 51,9 | 24,6 | 423,2 |
| Tasa de interés | 5,00% | 5,00% | 5,00% | 5,00% | 5,00% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 2 014,9 | 6 389,6 | 7 038,9 | 6 963,0 | 7 038,2 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 4 751,8 | 1 778,6 | 5 298,0 | 6 445,9 | 7 038,6 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 11,0 | 6,6 | 15,0 | 16,9 | 17,9 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 2 973,3 | 0,0 | 3 519,5 | 4 667,3 | 5 260,0 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,9 | 0,0 | 10,0 | 12,3 | 13,3 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u> | 547,2 | 323,2 | 97,2 | 187,9 | 438,1 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 5,60/5,80/5,76 | 5,75/6,55/5,95 | 5,70/6,25/5,94 | 5,80/6,00/5,82 | 5,70/6,00/5,77 |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u> | 0,0 | 7,0 | 21,8 | 23,0 | 28,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | 2,00/2,10/2,01 | 2,00/2,70/2,40 | 2,05/2,60/2,15 | 2,15/2,70/2,20 |
| c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u> | 191,1 | 490,5 | 309,0 | 153,0 | 83,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | 3,0/6,48 |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 26 Junio | 30 Junio | 01 Julio | 02 Julio | 03 Julio |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | -69,8 | -76,7 | 32,3 | 27,6 | -31,1 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | -72,6 | -120,9 | 38,0 | -81,3 | -114,0 |
| a. <u>Mercado spot con el público</u> | -30,0 | -4,3 | -82,5 | -62,3 | -14,8 |
| i. Compras | 206,5 | 343,9 | 129,8 | 263,4 | 182,3 |
| ii. (-) Ventas | 236,5 | 348,2 | 212,3 | 325,7 | 197,1 |
| b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u> | -288,4 | 29,1 | -32,2 | -184,3 | 126,2 |
| i. Pactadas | 141,7 | 357,3 | 80,1 | 251,7 | 194,4 |
| ii. (-) Vencidas | 430,1 | 328,2 | 112,3 | 436,0 | 68,2 |
| c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u> | -291,1 | -15,2 | -26,5 | -293,2 | 43,3 |
| i. Pactadas | 135,9 | 280,9 | 114,0 | 96,8 | 228,0 |
| ii. (-) Vencidas | 427,1 | 296,1 | 140,5 | 390,0 | 184,7 |
| d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u> | | | | | |
| i. Al contado | 437,4 | 223,4 | 141,0 | 319,6 | 492,2 |
| ii. A futuro | 27,0 | 61,0 | 45,0 | 39,0 | 29,0 |
| e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u> | -33,6 | -133,8 | 28,7 | -43,0 | 24,3 |
| i. Compras | 390,0 | 170,6 | 138,7 | 388,0 | 89,3 |
| ii. (-) Ventas | 423,6 | 304,3 | 110,0 | 431,0 | 65,0 |
| f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u> | -12,0 | -15,0 | 120,0 | -22,0 | -7,0 |
| g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u> | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,9639 | 2,9652 | 2,9636 | 2,9569 | 2,9025 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |