

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

| | 21 Julio | 22 Julio | 23 Julio | 24 Julio | 25 Julio |
|--|--------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 3 087,6 | 3 466,9 | 3 180,0 | 3 056,9 | 5 773,2 |
| 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) | | | | | |
| Saldo | 12 877,5 | 12 877,5 | 12 877,5 | 12 877,5 | -- |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (25 de agosto de 2008) | | | | | 12 877,5 |
| Vencimientos de CDBCRP del 23 al 25 de julio del 2008 | | | | | 960,1 |
| | | | | | 0,0 |
| 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) | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Saldo | 283,0 | 283,0 | 283,0 | 283,0 | -- |
| Próximo vencimiento de Depósitos (29 de diciembre de 2008) | | | | | 283,0 |
| v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | 25,0 100,0 1099,9 | 50,0 100,0 1550,1 | 80,0 75,0 1670,0 | 50,0 33,2 1550,0 | 97,0 191,3 1373,0 1856,3 |
| Propuestas recibidas | 43,0 180,0 1309,4 | 116,0 135,6 2068,9 | 127,0 110,0 1744,7 | 82,7 98,2 1763,4 | 112,5 244,3 1558,0 1987,8 |
| Plazo de vencimiento | 1 a. 4 m. 1 d. | 1 a. 4 m. 1 d. | 1 a. 4 m. 1 d. | 1 a. 4 m. 1 d. | 1 a. 3 m. 1 s. 5 d. |
| Tasas de interés: Mínima | 7,00 6,53 5,82 | 6,99 6,58 5,82 | 6,98 6,60 5,82 | 6,98 6,48 5,55 | 6,98 6,45 5,80 5,55 |
| Máxima | 7,00 6,60 5,97 | 7,00 6,60 5,93 | 7,00 6,60 6,01 | 6,99 6,60 6,01 | 6,99 6,55 6,10 6,01 |
| Promedio | 7,00 6,58 5,94 | 6,99 6,59 5,87 | 6,99 6,60 5,90 | 6,99 6,56 5,86 | 6,98 6,53 5,99 5,92 |
| Saldo | 21 814,8 | 21 631,0 | 21 905,9 | 21 869,1 | 20 537,7 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (23 de julio de 2008) | | | 1 670,0 | | 1 856,3 |
| Vencimientos de CDBCRP-NR del 23 al 25 de julio del 2008 | | | 4 969,0 | | 3 229,3 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| c. Operaciones con el Tesoro Público | -30,00 | 0,00 | -30,00 | 0,00 | 0,00 |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | 30,0 | 0,0 | 30,0 | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 1 862,7 | 1 766,8 | 1 355,0 | 1 423,7 | 2 255,6 |
| 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) | 0,0124% | 0,0124% | 0,0124% | 0,0124% | 0,0139% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 6,75% | 6,75% | 6,75% | 6,75% | 6,75% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 6,75% | 6,75% | 6,75% | 6,75% | 6,75% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 0,0 | 294,5 | 36,5 | 226,0 | 134,0 |
| | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 1 862,7 | 1 472,3 | 1 318,5 | 1 197,7 | 2 121,6 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 5 858,7 | 5 740,2 | 5 625,3 | 5 514,9 | 5 450,3 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 13,7 | 13,4 | 13,1 | 12,9 | 12,7 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 4 080,2 | 3 961,7 | 3 846,7 | 3 736,4 | 3 671,8 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,5 | 9,2 | 9,0 | 8,7 | 8,6 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 382,7 | 310,0 | 402,9 | 426,8 | 365,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 6,00/6,00/5,99 | 5,95/6,00/5,99 | 5,95/6,00/6,00 | 5,85/6,00/5,95 | 5,90/6,00/5,99 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 25,2 | 41,4 | 19,4 | 14,2 | 110,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 2,75/2,80/2,76 | 2,50/2,75/2,57 | 2,00/2,55/2,14 | 1,80/2,55/2,09 | 2,00/2,55/2,09 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR | 196,3 | 124,0 | 54,5 | 44,4 | 171,9 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | 40,0/6,99 | 22,5/6,99 | 24,4/6,99 | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 17 Julio | 21 Julio | 22 Julio | 23 Julio | 24 Julio |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | -1,2 | -40,6 | 48,1 | -69,9 | -62,8 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | -32,7 | -200,4 | 234,1 | -80,4 | -120,4 |
| a. Mercado spot con el público | 4,5 | -120,5 | 243,9 | -58,0 | -101,6 |
| i. Compras | 173,1 | 193,6 | 384,8 | 191,6 | 206,5 |
| ii. (-) Ventas | 168,6 | 314,1 | 140,9 | 249,6 | 308,1 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -33,4 | -113,4 | -53,1 | 110,6 | -93,4 |
| i. Pactadas | 136,0 | 113,1 | 89,9 | 239,4 | 169,0 |
| ii. (-) Vencidas | 169,4 | 226,5 | 143,0 | 128,8 | 262,4 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -64,9 | -273,2 | 132,9 | 100,1 | -151,0 |
| i. Pactadas | 114,1 | 128,0 | 258,7 | 221,9 | 136,3 |
| ii. (-) Vencidas | 179,0 | 401,2 | 125,8 | 121,8 | 287,3 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 492,1 | 250,3 | 214,9 | 339,2 | 168,8 |
| ii. A futuro | 19,0 | 8,0 | 17,7 | 26,1 | 42,5 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -59,6 | 95,8 | -26,0 | -11,4 | 21,1 |
| i. Compras | 101,4 | 316,0 | 111,0 | 115,5 | 275,3 |
| ii. (-) Ventas | 161,0 | 220,2 | 137,0 | 126,9 | 254,2 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 32,0 | -1,0 | -1,0 | -18,0 | -15,0 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 2,8319 | 2,8403 | 2,8437 | 2,8349 | 2,8294 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |