

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

	29 Setiembre	30 Setiembre	01 Octubre	02 Octubre
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>	<b>2 920,5</b>	<b>1 724,2</b>	<b>2 705,5</b>	<b>4 209,9</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>				
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>				
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>				
Saldo	11 712,4	--	--	--
Próximo vencimiento de CDBCRP (20 de octubre de 2008)		1 143,0	1 143,0	11 712,4
Vencimientos de CDBCRP del 01 al 03 de octubre del 2008		0,0	0,0	
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores</u>			1500,0 1100,0	1 500,0 700,0
Propuestas recibidas			3858,0 3448,0	2 705,0 2 109,0
Plazo de vencimiento			1 s. 1d.	1 s. 1 d.
Tasas de interés: Mínima			6,70 6,84	6,90 6,91
Máxima			7,17 6,88	7,05 6,92
Promedio			6,92 6,87	7,02 6,91
Saldo			2 600,0	3 700,0
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>			--	
Saldo				
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>			0,0	
Saldo	283,0	283,0	283,00	283,0
Próximo vencimiento de Depósitos (29 de diciembre de 2008)				
v. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</u>	<u>817,5</u>	<u>440,6</u>		
Propuestas recibidas	817,5	440,6		
Plazo de vencimiento			1 d. 1 d.	
Tasas de interés: Mínima	6,27	6,39		
Máxima	6,50	6,50		
Promedio	6,44	6,46		
Saldo	15 221,1	14 844,2	14 096,0	14 096,0
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (01 de octubre de 2008)			1 978,2	
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (del 01 al 03 de octubre del 2008)			0,0	
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	<u>-1248,0</u>	<u>-26,9</u>		<u>-1333,7</u>
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>				
Tipo de cambio promedio				
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>	418,6	9,0		443,8
Tipo de cambio promedio	2,9813	2,9834		3,0052
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público</u>	<u>0,0</u>	<u>-50,0</u>		
i. <u>Compras (millones de US\$) - Tesoro Público</u>				
ii. <u>Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público</u>		50,0		
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>855,0</b>	<b>1 256,7</b>	<b>5 305,5</b>	<b>5 076,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0118%	0,0118%	0,0118%	0,0117%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>				
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>25,0</u>	<u>408,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
Tasa de interés	5,75%	5,75%	5,75%	5,75%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>830,0</b>	<b>768,8</b>	<b>5 305,5</b>	<b>5 076,2</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	4 717,5	4 662,8	7 084,1	6 969,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	11,0	10,8	26,4	19,8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	2 939,0	2 884,3	5 305,5	5 190,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,7	19,7	14,7
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>557,6</u>	<u>759,0</u>	<u>137,2</u>	<u>49,8</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	6,45/6,60/6,51	6,50/6,65/6,52	6,50/6,60/6,53	6,60/6,70/6,62
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>139,9</u>	<u>136,2</u>	<u>59,6</u>	<u>67,4</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,00/2,75/2,41	2,50/3,25/2,88	3,25/4,00/3,29	4,00/4,65/4,49
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u>	<u>134,6</u>	<u>128,6</u>	<u>126,2</u>	<u>222,4</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		30,0/7,20		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>26 Setiembre</b>	<b>29 Setiembre</b>	<b>30 Setiembre</b>	<b>01 Octubre</b>
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	28,5	131,8	-72,1	-11,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	12,9	200,8	-88,8	-130,4
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>21,2</u>	<u>-210,2</u>	<u>-56,3</u>	<u>-131,3</u>
i. Compras	189,2	171,8	222,9	130,5
ii. (-) Ventas	168,0	382,1	279,1	261,8
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-29,1</u>	<u>-6,1</u>	<u>13,2</u>	<u>168,7</u>
i. Pactadas	140,0	6,2	235,6	268,0
ii. (-) Vencidas	169,1	12,3	222,4	99,3
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>-44,7</u>	<u>62,9</u>	<u>-3,5</u>	<u>50,0</u>
i. Pactadas	89,7	102,5	213,6	199,1
ii. (-) Vencidas	134,4	39,6	217,2	149,1
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	250,4	191,7	312,3	135,7
ii. A futuro	65,0	68,0	164,0	13,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entreg</u>	<u>-43,0</u>	<u>17,8</u>	<u>-48,8</u>	<u>37,6</u>
i. Compras	113,9	26,2	155,2	130,6
ii. (-) Ventas	156,9	8,4	203,9	93,0
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>0,0</u>	<u>420,6</u>	<u>11,0</u>	<u>13,0</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9710	2,9813	2,9775	2,9829
(*) Datos preliminares				