

| BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ | | | | | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS | | | | | | | |
| (En millones de S/.) | | | | | | | |
| | 27 octubre | 28 octubre | 29 octubre | | | 30 octubre | 31 octubre |
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | -240,9 | 67,7 | 167,6 | | | 47,9 | 61,4 |
| 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) | | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | 60,0 | 30,0 | 40,0 | 25,0 | 20,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 140,8 | 47,9 | 57,9 | 93,0 | 40,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | 1 año | 6 meses | 7 días | 1 año | 3 años |
| Saldo | 4 019,7 | 4 019,7 | 3,38/3,44/3,41 | 3,05/3,12/3,10 | 2,70/2,82/2,78 | 3,40/3,50/3,46 | 4,91/4,99/4,96 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (5 de noviembre de 2003) | | | | 4 124,7 | | 4 149,7 | 4 189,7 |
| Vencimientos de CDBCRP del 3 al 7 de noviembre de 2003 | | | | | | | 40,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP | 270,0 | 55,0 | | | | | 90,0 |
| Propuestas recibidas | 369,0 | 91,0 | | | | | |
| Plazo de vencimiento | 1 día | 1 día | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 2,71/2,81/2,76 | 2,83/2,85/2,84 | | | | | |
| Saldo | 270,0 | 55,0 | | | | | |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP) | | | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | | | |
| Saldo | | | | | | | |
| Próximo vencimiento | | | | | | | |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 34,8 | 34,8 | 52,1 | | | 34,7 | 34,7 |
| i. Compras (millones de US\$) | 10,0 | 10,0 | 15,0 | | | 10,0 | 10,0 |
| Tipo de cambio promedio | 3,4762 | 3,4758 | 3,4728 | | | 3,4721 | 3,4728 |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 63,9 | 157,5 | 89,7 | | | 57,6 | 56,1 |
| 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) | 0,0072% | 0,0072% | | | 0,0072% | | 0,0067% |
| b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta) | | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | | | |
| Tasa de interés | 3,50% | 3,50% | 3,50% | | | 3,50% | 3,50% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 7,5 | 101,8 | 25,0 | | | 25,5 | |
| Tasa de interés | 2,00% | 2,00% | 2,00% | | | 2,00% | 2,00% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 56,4 | 55,7 | 64,7 | | | 32,1 | 56,1 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 869,4 | 864,4 | 860,1 | | | 855,0 | 851,0 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,3 | 6,2 | 6,2 | | | 6,2 | 6,1 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 194,7 | 189,8 | 185,5 | | | 180,4 | 176,3 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1,4 | 1,4 | 1,3 | | | 1,3 | 1,3 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 122,3 | 80,5 | 128,3 | | | 163,7 | 154,6 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 2,70/2,85/2,79 | 2,60/2,80/2,70 | 2,40/2,75/2,57 | | | 2,60/2,75/2,71 | 2,70/2,75/2,71 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera | 5,0 | | | | | 5,5 | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,10/1,10/1,10 | | | | | 1,10/1,15/1,11 | |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 23,9 | 23,0 | 2,0 | | | 23,6 | 32,2 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | | | 2,0 / 3,50 | 10,0 / 2,98 |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | | | | | | | |
| Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f | -9,5 | -17,8 | -33,4 | | | 0,7 | -5,4 |
| Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f | -11,6 | -20,1 | -22,7 | | | 3,0 | -12,9 |
| a. Mercado spot con el público (**) | -6,5 | -9,6 | -8,4 | | | 13,5 | -2,5 |
| i. Compras | 45,2 | 45,8 | 46,9 | | | 67,2 | 30,3 |
| ii. (-) Ventas | 51,7 | 55,4 | 55,3 | | | 53,7 | 32,8 |
| b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**) | -0,4 | 4,1 | -12,2 | | | -6,6 | 8,0 |
| i. Pactadas | 1,7 | 4,1 | 5,4 | | | 1,5 | 31,0 |
| ii. (-) Vencidas | 2,0 | | 17,7 | | | 8,1 | 23,0 |
| c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**) | -2,5 | 1,8 | -1,6 | | | -4,3 | 0,5 |
| i. Pactadas | 20,0 | 40,3 | 2,0 | | | 1,3 | 11,2 |
| ii. (-) Vencidas | 22,5 | 38,5 | 3,6 | | | 5,6 | 10,8 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias (**) | | | | | | | |
| i. Al contado | 36,4 | 64,5 | 86,0 | | | 56,6 | 55,8 |
| ii. A futuro | 5,6 | 14,9 | 28,0 | | | 17,5 | 5,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**) | 20,4 | 35,5 | -12,4 | | | -3,0 | -13,2 |
| i. Compras | 22,4 | 35,5 | 3,6 | | | 5,0 | 9,8 |
| ii. (-) Ventas | 2,0 | | 16,0 | | | 8,0 | 23,0 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -5,0 | -7,5 | -16,0 | | | -10,0 | -9,5 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio | 3,476 | 3,476 | 3,474 | | | 3,472 | 3,472 |
| * Datos preliminares | | | | | | | |
| ** Datos preliminares para el último día | | | | | | | |