

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

	07 Julio	08 Julio	09 Julio	10 Julio
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	5 570,1	6 327,7	6 731,2	6 605,8
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	--			
Próximo vencimiento de CDBCRP (25 de agosto de 2008)	12 877,5	12 877,5	12 877,5	12 877,5
Vencimientos de CDBCRP del 09 al 11 de julio del 2008				
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores</u>	<u>1000,0</u>	<u>500,0</u>		
Propuestas recibidas	2964,9	521,0		
Plazo de vencimiento	1 d.	1 d.		
Tasas de interés: Mínima	5,97	5,76		
Máxima	5,97	6,05		
Promedio	5,97	5,77		
Saldo	1 000,0			
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>				
Saldo	--			
iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u>	--			
Saldo	283,0	283,0	283,0	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>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>1000</u>	<u>1964,0</u>
Propuestas recibidas			2809,1	2064,0
Plazo de vencimiento			1 d.	1 d.
Tasas de interés: Mínima			5,51	5,51
Máxima			5,59	5,74
Promedio			5,56	5,65
Saldo	19 330,0	19 330,0	20 330,0	21 294,0
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (21 de julio de 2008)				
Vencimientos de CDBCRP-NR del 09 al 11 de julio del 2008				
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>
i. <u>Compras (millones de US\$)</u>				
Tipo de cambio promedio				
ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>				
Tipo de cambio promedio				
c. <u>Operaciones con el Tesoro Público</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</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	6 570,1	6 827,7	5 731,2	4 641,8
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)	0,0123%	0,0123%	0,0125%	0,0125%
b. <u>Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)</u>				
Tasa de interés	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%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	<u>323,0</u>	<u>44,5</u>	<u>413,6</u>	<u>2,7</u>
Tasa de interés	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	6 247,1	6 783,2	5 317,6	4 639,1
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	7 687,6	8 561,8	8 398,9	8 200,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	18,7	20,6	20,1	19,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	5 909,1	6 783,2	6 620,4	6 422,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	14,3	16,3	15,9	15,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	<u>509,2</u>	<u>477,6</u>	<u>496,0</u>	<u>342,7</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,75/5,80/5,76	5,75/5,85/5,75	5,50/5,80/5,75	5,50/5,80/5,75
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u>	<u>20,2</u>	<u>51,6</u>	<u>27,7</u>	<u>50,1</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,20/2,25/2,24	2,25/2,50/2,42	2,50/2,75/2,56	2,55/2,60/2,56
c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u>	<u>280,0</u>	<u>431,0</u>	<u>384,7</u>	<u>151,0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	36,0/6,49	20,0/6,47		10,0/6,43
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	04 Julio	07 Julio	08 Julio	09 Julio
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f	24,8	-85,1	44,7	49,5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f	40,3	-130,0	69,7	-166,9
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>42,2</u>	<u>-73,8</u>	<u>25,7</u>	<u>-84,2</u>
i. Compras	211,7	173,9	251,3	215,6
ii. (-) Ventas	169,5	247,7	225,6	299,8
b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>34,0</u>	<u>139,7</u>	<u>-8,3</u>	<u>224,3</u>
i. Pactadas	127,5	361,2	188,0	308,5
ii. (-) Vencidas	93,5	221,5	196,3	84,2
c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u>	<u>49,5</u>	<u>94,8</u>	<u>16,7</u>	<u>7,9</u>
i. Pactadas	89,3	313,8	204,9	287,6
ii. (-) Vencidas	39,8	219,0	188,2	279,7
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>				
i. Al contado	308,5	442,9	470,7	337,2
ii. A futuro	5,0	24,0	3,0	98,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>-60,6</u>	<u>-52,7</u>	<u>1,9</u>	<u>103,8</u>
i. Compras	10,9	149,0	183,0	187,2
ii. (-) Ventas	71,5	201,7	181,1	83,4
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>5,0</u>	<u>-6,0</u>	<u>34,0</u>	<u>9,0</u>
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,8875	2,8539	2,8155	2,8075
(*) Datos preliminares				