

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

	29 Setiembre	30 Setiembre	01 Octubre	02 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	2 920,5	1 724,2	2 705,5	4 209,9
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	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. Subasta de Compra Temporal de Valores			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. 1d.
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. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)			--	
Saldo				
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			0,0	
Saldo	283,0	283,0	283,00	283,0
Próximo vencimiento de Depósitos (29 de diciembre de 2008)				
v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)	<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. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>-1248,0</u>	<u>-26,9</u>		<u>-1333,7</u>
i. Compras (millones de US\$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)	418,6	9,0		443,8
Tipo de cambio promedio	2,9813	2,9834		3,0052
c. Operaciones con el Tesoro Público	<u>0,0</u>	<u>-50,0</u>		
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público				
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público		50,0		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	855,0	1 256,7	5 305,5	5 076,2
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)	0,0118%	0,0118%	0,0118%	0,0117%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<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%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	830,0	768,8	5 305,5	5 076,2
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
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<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. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<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. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR	<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)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	26 Setiembre	29 Setiembre	30 Setiembre	01 Octubre
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. Mercado spot con el público	<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. Compras forward al público (con y sin entrega)	<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. Ventas forward al público (con y sin entrega)	<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. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	250,4	191,7	312,3	135,7
ii. A futuro	65,0	68,0	164,0	13,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entreg	<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. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>0,0</u>	<u>420,6</u>	<u>11,0</u>	<u>13,0</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	2,9710	2,9813	2,9775	2,9829
(*) Datos preliminares				