

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

| | 06 Octubre | 07 Octubre | 09 Octubre | 10 Octubre |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 5 135,9 | 5 402,7 | 1 643,4 | 2 925,5 |
| 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 (20 octubre de 2008) | 11 712,4 | 11 712,4 | 11 712,4 | 11 712,4 |
| Vencimientos de CDBCRP del 09 al 10 de octubre de 2008 | | 1 443,0 | | 1 443,0 |
| | | 0,0 | | 0,0 |
| ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores</u> | 200,0 | 1000,0 | 2 500,0 | 1 000,0 |
| Propuestas recibidas | 624,0 | 1 635,0 | 4 099,0 | 1 126,9 |
| Plazo de vencimiento | 1 m. | 1 s. | 1 s. | 1 d. |
| Tasas de interés: Mínima | 6,92 | 7,07 | 7,05 | 7,00 |
| Máxima | 7,66 | 7,31 | 7,31 | 7,25 |
| Promedio | 7,03 | 7,19 | 7,24 | 7,08 |
| Saldo | 5 200,0 | 5 200,0 | 5 700,0 | 7 200,2 |
| iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u> | | | 300,0 | 150,0 |
| Propuestas recibidas | | | 340,0 | 220,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 3 m. | 3 m. |
| Tasas de interés: Mínima | | | 4,89 | 4,94 |
| Máxima | | | 4,94 | 5,00 |
| Promedio | | | 4,92 | 4,97 |
| Saldo | | | | 465,0 |
| Próximo vencimiento de CDRBCRP | | | | 465,0 |
| iv. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</u> | -- | -- | -- | -- |
| Saldo | 283,0 | 283,0 | 283,0 | 283,0 |
| v. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)</u> | | | | |
| Saldo | 14 096,0 | 14 096,0 | 14 096,0 | 14 096,0 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (20 de octubre de 2008) | 1 978,2 | 1 978,2 | | 1 978,2 |
| Vencimientos de CDBCRP del 09 al 10 de octubre de 2008 | -- | -- | -- | -- |
| b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u> | -1208,6 | -772,4 | -880,9 | -1 096,3 |
| i. <u>Compras (millones de US\$)</u> | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | |
| ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u> | 393,0 | 249,0 | 280,5 | 354,5 |
| Tipo de cambio promedio | 3,0753 | 3,1022 | 3,1403 | 3,0925 |
| c. <u>Operaciones con el Tesoro Público</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 | 5 127,3 | 4 630,3 | 3 812,5 | 4 314,4 |
| 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) | 0,0114% | 0,0105% | 0,0080% | 0,0092% |
| 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> | 51,0 | 16,5 | 10,0 | 15,0 |
| 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 | 5 076,3 | 4 613,8 | 3 802,5 | 4 299,4 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 7 558,6 | 7 392,0 | 7 079,7 | 6 979,6 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 18,5 | 17,9 | 17,0 | 16,6 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 5 780,1 | 5 613,5 | 5 301,2 | 5 201,0 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 14,2 | 13,6 | 12,7 | 12,4 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u> | 256,7 | 93,9 | 88,0 | 220,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 6,65/6,80/6,74 | 6,60/6,60/6,60 | 6,60/7,15/6,69 | 6,60/7,35/7,05 |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)</u> | 15,9 | 27,0 | 20,4 | 23,9 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 4,00/5,50/5,06 | 3,00/5,00/3,48 | 1,30/4,00/3,29 | 0,75/3,00/2,92 |
| c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR</u> | 389,0 | 199,3 | 67,0 | 0,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | | | | |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio) | | | | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | 03 Octubre | 06 Octubre | 07 Octubre | 09 Octubre |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | 9,5 | 95,0 | -1,4 | 14,4 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 19,8 | 299,0 | 128,2 | 178,4 |
| a. <u> Mercado spot con el público</u> | -78,0 | -95,4 | -113,5 | -233,0 |
| i. <u>Compras</u> | 158,8 | 154,6 | 178,6 | 148,2 |
| ii. (-) <u>Ventas</u> | 236,8 | 250,0 | 292,1 | 381,2 |
| b. <u>Compras forward al público (con y sin entrega)</u> | 61,7 | -268,8 | -15,0 | -74,1 |
| i. <u>Pactadas</u> | 88,1 | 28,9 | 64,0 | 51,5 |
| ii. (-) <u>Vencidas</u> | 26,5 | 297,7 | 79,0 | 125,6 |
| c. <u>Ventas forward al público (con y sin entrega)</u> | 71,9 | -64,8 | 114,6 | 89,9 |
| i. <u>Pactadas</u> | 158,8 | 195,2 | 144,4 | 228,8 |
| ii. (-) <u>Vencidas</u> | 86,9 | 260,0 | 29,8 | 138,9 |
| d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u> | | | | |
| i. <u>Al contado</u> | 239,5 | 83,3 | 101,9 | 102,3 |
| ii. <u>A futuro</u> | 21,0 | 0,0 | 43,0 | 39,5 |
| e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u> | 60,2 | -38,3 | -56,5 | 11,0 |
| i. <u>Compras</u> | 84,5 | 255,0 | 21,5 | 130,7 |
| ii. (-) <u>Ventas</u> | 24,3 | 293,3 | 78,0 | 119,7 |
| f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u> | 98,0 | 395,0 | 249,0 | 413,6 |
| g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u> | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,0033 | 3,0750 | 3,1032 | 3,1440 |
| (*) Datos preliminares | | | | |