

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

| | 20 Octubre | 21 Octubre | 22 Octubre | 23 Octubre | 24 Octubre |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 3 066,3 | 2 796,3 | 2 071,0 | -516,6 | -1 297,8 |
| 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 | -- | -- | -- | -- | -- |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (06 noviembre del 2008) | 10 269,4 | 10 269,4 | 10 269,4 | 10 269,4 | 10 269,4 |
| Vencimientos de CDBCRP del 23 al 24 de octubre del 2008 | 0,0 | | | | 1 155,0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo) | | | 514,0 | 1500,0 874,8 | 1 500,0 300,0 850,0 |
| Propuestas recibidas | | | 1 184,0 | 2 200,0 974,8 | 2 361,0 730,0 1 150,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 1 m. | 1 s. 1 s. | 1 s. 3 m. 3 d. |
| Tasas de interés: Mínima | | | 6,75 | 6,76 6,55 | 6,58 7,15 6,50 |
| Máxima | | | 7,13 | 7,16 6,77 | 6,90 7,28 6,55 |
| Promedio | | | 6,91 | 6,77 6,62 | 6,61 7,23 6,53 |
| Saldo | 4 606,7 | 4 606,7 | 5 085,7 | 5 460,5 | 5 738,8 |
| Próximo vencimiento de Repo (23 octubre del 2008) | | 35,0 | | | 850,0 |
| Vencimientos de Repo del 23 al 24 de octubre del 2008 | | 4 406,7 | | | 4 724,8 |
| iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable del BCR (CDR-BCRP) | | 300,0 255,0 | 300,0 | 240,0 75,0 | 60,0 |
| Propuestas recibidas | | 390,0 355,0 | 360,0 | 390,0 75,0 | 60,0 |
| Plazo de vencimiento | | 3 m. 3 m. | 3 m. | 4 m. 4 m. | 4 m. |
| Tasas de interés: Mínima | | 3,99 4,00 | 3,80 | 3,99 6,55 | 3,99 |
| Máxima | | 4,20 4,29 | 3,95 | 3,99 6,77 | 3,99 |
| Promedio | | 4,08 4,20 | 3,85 | 3,99 6,62 | 3,99 |
| Saldo | 755,0 | 1 310,0 | 1 610,0 | 1 925,0 | 1 985,0 |
| Próximo vencimiento de CDRBCRP (07 de enero del 2009) | 465,0 | 465,0 | | | 465,0 |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional | | | | | |
| Saldo | -- | -- | -- | -- | -- |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (06 de noviembre de 2008) | 283,0 | 283,0 | 283,0 | 283,0 | 283,0 |
| Vencimientos de CDBCRP del 23 al 24 de octubre del 2008 | 0,0 | | | | 0,0 |
| v. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR) | | | | | |
| Saldo | -- | -- | -- | -- | -- |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR (06 de noviembre de 2008) | 12 117,8 | 12 117,8 | 12 117,8 | 12 117,8 | 12 117,8 |
| Vencimientos de CDBCRP del 23 al 24 de octubre del 2008 | 0,0 | 2 328,8 | 2 328,8 | | 2 328,8 |
| Vencimientos de CDBCRP del 23 al 24 de octubre del 2008 | | 0,0 | | | 0,0 |
| vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera | | | 148,1 | 218,5 | 300,0 |
| Propuestas recibidas | | | 148,1 | 218,5 | 494,0 |
| Plazo de vencimiento | | | 1 d. | 1 d. | 3 d. |
| Tasas de interés: Mínima | | | 6,50 | 6,51 | 6,52 |
| Máxima | | | 6,52 | 6,52 | 6,58 |
| Promedio | | | 6,50 | 6,51 | 6,52 |
| Saldo | | | 148,1 | 218,5 | 300,0 |
| Próximo vencimiento de Repo (23 octubre del 2008) | 0,0 | 0,0 | | | 300,0 |
| Vencimientos de Repo del 23 al 24 de octubre del 2008 | 0,0 | 0,0 | | | 300,0 |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR | 0,0 | 0,0 | -541,6 | -216,8 | -363,7 |
| i. Compras (millones de US\$) | | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) | | | 175,0 | 70,0 | 117,0 |
| Tipo de cambio promedio | | | 3,0946 | 3,0965 | 3,1084 |
| c. Operaciones con el Tesoro Público | -25,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público | | | | | |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público | 25,0 | | | | |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones | 3 066,3 | 2 241,3 | 1 891,5 | 1 544,9 | 1 228,5 |
| 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) | 0,0115% | 0,0114% | 0,0113% | 0,0114% | 0,0124% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 7,25% | 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% | 7,25% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 1 035,0 | 615,0 | 576,0 | 850,0 | 278,5 |
| Tasa de interés | 5,75% | 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 | 2 031,3 | 1 626,3 | 1 315,5 | 694,9 | 950,0 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 5 856,4 | 5 739,7 | 5 619,4 | 5 482,6 | 5 367,9 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 13,7 | 13,4 | 13,1 | 12,8 | 12,5 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 4 077,8 | 3 961,1 | 3 840,8 | 3 704,1 | 3 589,3 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 9,5 | 9,3 | 9,0 | 8,6 | 8,4 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 465,7 | 557,5 | 382,5 | 401,0 | 676,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 6,45/6,65/6,51 | 6,50/6,65/6,50 | 6,50/6,55/6,51 | 6,50/6,60/6,53 | 6,50/6,60/6,56 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) | 100,0 | 5,9 | 0,9 | 22,2 | 17,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,00/1,00/1,00 | 0,40/0,40/0,40 | 0,40/0,40/0,40 | 0,50/1,00/0,86 | 0,50/1,50/0,99 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP y CDBCRP-NR | 125,0 | 132,5 | 54,0 | 45,1 | 204,0 |
| 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\$) | 17 Octubre | 20 Octubre | 21 Octubre | 22 Octubre | 23 Octubre |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f | -0,3 | -71,5 | 63,7 | 4,0 | 53,7 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + f | 28,3 | -227,5 | 178,4 | 192,1 | 208,6 |
| a. Mercado spot con el público | -152,8 | -80,0 | -7,7 | -79,9 | 16,2 |
| i. Compras | 130,0 | 210,2 | 141,4 | 135,5 | 174,8 |
| ii. (-) Ventas | 282,8 | 290,2 | 149,1 | 215,4 | 158,6 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) | -54,3 | -60,0 | 6,7 | -54,2 | -249,2 |
| i. Pactadas | 117,0 | 63,7 | 85,6 | 81,0 | 82,6 |
| ii. (-) Vencidas | 171,3 | 123,7 | 78,9 | 135,2 | 331,8 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) | -25,6 | -216,0 | 121,4 | 133,9 | -94,3 |
| i. Pactadas | 151,8 | 313,5 | 164,1 | 228,2 | 149,2 |
| ii. (-) Vencidas | 177,4 | 529,5 | 42,7 | 94,3 | 243,5 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 156,7 | 101,5 | 138,6 | 90,9 | 212,3 |
| ii. A futuro | 8,0 | 25,0 | 11,0 | 63,0 | 75,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 7,0 | 253,4 | -35,0 | -41,6 | -75,7 |
| i. Compras | 175,2 | 366,0 | 40,5 | 93,0 | 232,2 |
| ii. (-) Ventas | 168,2 | 112,6 | 75,5 | 134,6 | 307,9 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 180,3 | 5,0 | 185,0 | 272,7 | 179,7 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,0686 | 3,0501 | 3,0838 | 3,1024 | 3,0960 |
| (*) Datos preliminares | | | | | |