

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(En millones de S/.)

	12 enero	13 enero	14 enero	15 enero	16 enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	399,1	198,4	50,3	-22,1	281,0
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	26,5	92,7	100,0	80,0	80,0
Plazo de vencimiento	26,5	123,7	125,5	167,5	167,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 semana	9 meses	1 año	3 años	1 año
Saldo	2,53/2,63/2,57	2,90/3,12/3,03	3,15/3,50/3,30	4,61/4,82/4,75	3,18/3,50/3,37
Próximo vencimiento de CDBCRP (19 de enero de 2004)	5 324,4		5 405,0	5 335,0	5 305,0
Vencimientos de CDBCRP del 19 al 23 de enero de 2004					2,60/2,80/2,72
					5 284,5
					26,5
					26,5
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP			60,0	140,0	
Propuestas recibidas			241,0	396,0	
Plazo de vencimiento			1 día	1 día	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			2,50/2,53/2,52	2,54/2,56/2,55	
Saldo			60,0	140,0	
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable 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	86,5	51,9	102,0	103,6	138,1
i. Compras (millones de US\$)	25,0	15,0	29,5	30,0	40,0
Tipo de cambio promedio	3,4593	3,4606	3,4569	3,4535	3,4530
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	186,4	169,7	212,3	221,5	369,1
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)	0,0073%	0,0073%	0,0102%	0,0102%	0,0092%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					98,5
Tasa de interés	1,75%	1,75%	1,75%	1,75%	1,75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	186,4	169,7	212,3	221,5	270,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	996,1	990,5	988,9	988,0	990,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,0	7,0	7,0	7,0	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	241,4	235,9	234,3	233,4	235,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,6	1,6	1,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	42,1	190,2	142,1	141,4	129,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,25/2,50/2,32	2,35/2,65/2,51	2,50/2,55/2,53	2,55/2,60/2,56	2,00/2,55/2,27
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	14,0	5,0	11,0	10,7	26,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,10/1,25/1,19	1,15/1,15/1,15	0,98/1,15/1,06	1,03/1,25/1,11	0,98/1,15/1,10
c. Total mercado secundario de CDBCRP	28,0	104,4	35,0	32,5	8,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		10,0 / 3,04			3,0 / 2,76
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		9,0 / 3,23	14,0 / 3,27		
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)	23,0 / 3,16				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f	-6,7	36,1	42,2	13,4	-25,3
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	-22,4	21,7	40,6	-4,4	-2,5
a. Mercado spot con el público (**)	6,3	29,7	71,2	27,6	39,7
i. Compras	55,2	68,9	118,3	70,1	70,2
ii. (-) Ventas	48,9	39,2	47,1	42,5	30,5
b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)	7,7	16,8	-12,8	17,7	-2,9
i. Pactadas	17,7	21,9	5,0	25,4	4,1
ii. (-) Vencidas	10,0	5,1	17,8	7,7	7,0
c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)	-8,0	2,3	-14,4	0,0	19,9
i. Pactadas	10,2	2,7	27,8	2,1	22,2
ii. (-) Vencidas	18,2	0,3	42,2	2,1	2,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)					
i. Al contado	64,8	81,9	88,0	95,7	64,5
ii. A futuro	16,6	17,0	4,0	12,7	0,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	0,0	-1,8	25,8	-6,5	-7,0
i. Compras	10,0	0,2	36,3	1,0	0,0
ii. (-) Ventas	10,0	2,0	10,5	7,5	7,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-20,5	-11,0	-32,0	-31,0	-40,0
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,458	3,460	3,457	3,454	3,452
* Datos preliminares					
** Datos preliminares para el último día					