

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

	16 agosto	17 agosto	18 agosto	19 agosto	20 agosto
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	426,5	329,0	101,1	29,8	94,6
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	60,0 224,5	30,0 35,0 120,0			
Plazo de vencimiento	222,0 251,0	132,0 117,0 139,9			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	9 meses 7 días	10 meses 8 meses 7 días			
Saldo	4,47/4,50/4,50 2,80/2,87/2,86	4,37/4,46/4,41 4,10/4,29/4,26 2,80/2,87/2,84			
Próximo vencimiento de CDBCRP (23 de agosto de 2004)	5 430,5	5 544,5	5 544,5	5 544,5	5 544,5
Vencimientos de CDBCRP del 20 de agosto de 2004		224,5	224,5		224,5
Vencimientos de CDBCRP del 20 de agosto de 2004		0,0	0,0		344,5
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP					
Propuestas recibidas			30,0	30,0	
Plazo de vencimiento			70,0	69,5	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			1 día	1 día	
Saldo			2,75/2,85/2,78	2,74/2,85/2,76	
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)			0,0		
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			13,5	126,7	6,8
i. Compras (millones de US\$)			4,0	37,5	2,0
Tipo de cambio promedio			3,3790	3,3786	3,3810
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	142,0	144,0	144,6	186,5	101,4
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)	0,0103%	0,0103%	0,0104%	0,0104%	0,0104%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	2,00%	59,0	30,0	20,0	12,0
Tasa de interés		2,00%	2,00%	2,00%	2,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	142,0	85,0	114,6	166,5	89,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 117,1	1 104,8	1 095,5	1 090,0	1 081,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,7	7,6	7,5	7,5	7,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	293,9	281,6	272,3	266,7	257,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	1,9	1,9	1,8	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	198,9	157,0	177,5	113,0	220,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,70/2,80/2,75	2,60/2,80/2,73	2,70/2,80/2,76	2,60/2,80/2,74	2,75/2,80/2,77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	19,5	4,0	36,0	51,0	27,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,55/1,56/1,56	1,48/1,48/1,48	1,37/1,50/1,39	1,45/1,49/1,47	1,48/1,50/1,50
c. Total mercado secundario de CDBCRP	8,0	2,0	8,0	14,0	4,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			3,0 / 4,00	2,0 / 3,95	2,0 / 3,90
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				6,0 / 4,65	2,0 / 4,65
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f	-4,6	-23,6	19,0	-9,8	25,3
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	-8,2	-11,6	19,4	-18,0	3,6
a. Mercado spot con el público (**)	-5,9	-16,5	27,8	19,4	-2,1
i. Compras	50,6	32,4	55,7	66,3	53,2
ii. (-) Ventas	56,6	48,9	28,0	46,9	55,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega) (**)	0,7	-13,6	22,7	2,6	37,5
i. Pactadas	0,7	2,0	22,7	7,7	38,2
ii. (-) Vencidas	0,0	15,6	0,0	5,2	0,6
c. Ventas forward al público (con y sin entrega) (**)	-2,9	-1,6	23,1	-5,6	15,8
i. Pactadas	21,0	13,6	40,5	13,8	18,4
ii. (-) Vencidas	23,9	15,2	17,4	19,4	2,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)					
i. Al contado	28,7	81,2	114,1	84,0	81,1
ii. A futuro	0,0	2,0	7,1	15,0	9,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	23,5	0,0	16,0	10,0	0,0
i. Compras	23,5	15,0	16,0	15,0	0,0
ii. (-) Ventas	0,0	15,0	0,0	5,0	0,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2,0	4,5	-7,0	-33,2	7,7
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,409	3,404	3,387	3,379	3,382
* Datos preliminares ** Datos preliminares para el último día					