

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

	13 setiembre			14 setiembre			15 setiembre			16 setiembre			17 setiembre		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	400,3			288,3			157,1			145,6			476,8		
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 (CDBCPR)	60,0	60,0	60,0	30,0	50,0	20,0	30,0	40,0	40,0	50,0	30,0	40,0	60,0	90,0	48,0
Propuestas recibidas	188,0	154,7	156,9	127,5	156,9	26,0	132,0	159,2	138,0	162,0	52,0	137,0	92,0	119,0	162,0
Plazo de vencimiento	1,5 años	1 años	7 días	16 meses	9 meses	7 días	1,5 años	1 año	1,5 años	9 meses	3 años	2 años	15 meses	10 meses	8 meses
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,05/5,18/5,15	3,60/4,45/4,35	2,73/2,79/7,25	4,74/4,80/4,77	4,03/4,08/4,07	2,70/2,80/2,75	4,95/5,02/5,01	4,25/4,25/4,25	4,84/4,89/4,89	3,84/3,88/3,87	6,53/6,58/6,55	5,40/5,54/5,50	4,50/4,69/4,59	3,96/4,16/4,07	3,80/4,07/3,96
Saldo	6 485,0			6 585,0			6 655,0			6 745,0			6 720,3		
Próximo vencimiento de CDBCPR (17 de Setiembre de 2004)													60,0		
Vencimientos de CDBCPR del 17 de setiembre de 2004													80,0		
ii. Subasta de compra temporal de CDBCPR y de BTP															
Propuestas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento															
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable 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				35,2			98,8			139,0					
i. Compras (millones de US\$)				10,5			29,5			41,5					
Tipo de cambio promedio				3,3490			3,3483			3,3485					
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	220,3			223,5			185,9			194,6			208,8		
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)	0,0105%			0,0105%			0,0105%			0,0105%			0,0095%		
b. Compra temporal de CDBCPR 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	4,0			1,0			16,0			30,0					
Tasa de interés	2,00%			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	216,3			222,5			185,9			178,6			178,8		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 089,0			1 084,1			1 077,4			1 071,1			1 065,5		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,4			7,4			7,3			7,3			7,3		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	291,1			286,2			279,5			273,2			267,6		
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0			2,0			1,9			1,9			1,8		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCPR															
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	197,3			301,0			231,5			178,3			192,5		
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	2,65/2,75/2,71			2,20/2,75/2,66			2,68/2,75/2,74			2,65/2,75/2,72			2,50/2,75/2,66		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	38,5			59,5			50,5			59,0			36,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,26/1,51/1,44			1,39/1,51/1,46			1,50/1,54/1,52			1,44/1,55/1,53			1,50/1,56/1,54		
c. Total mercado secundario de CDBCPR	3,5			15,0			83,4			8,0			39,4		
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	2,0 / 3,62						3,0 / 3,65								
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)															
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	6,9			-16,0			-12,7			-13,8			-6,7		
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	7,8			-19,7			-32,2			-30,2			14,1		
a. Mercado spot con el público (**)	3,8			-10,3			0,4			11,1			11,3		
i. Compras	64,7			34,9			48,0			61,6			38,6		
ii. (-) Ventas	60,9			45,2			47,6			50,5			27,4		
b. Compras forward al público (con y sin entrega) (**)	3,9			1,6			-3,0			-0,8			-12,5		
i. Pactadas	4,4			5,0			21,3			11,5			3,4		
ii. (-) Vencidas	0,5			3,4			30,3			12,3			15,9		
c. Ventas forward al público (con y sin entrega) (**)	4,8			-2,2			-28,5			-17,1			8,3		
i. Pactadas	5,0			3,6			3,2			27,7			22,0		
ii. (-) Vencidas	0,1			5,7			31,7			44,8			13,7		
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)															
i. Al contado	65,2			81,1			82,2			65,6			60,0		
ii. A futuro	9,0			5,0			7,1			10,5			0,0		
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	-0,5			3,5			-0,1			29,9			-5,0		
i. Compras	0,0			5,5			17,2			41,9			10,5		
ii. (-) Ventas	0,5			2,0			17,3			12,0			15,5		
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,1			-10,6			-31,1			-38,7			5,7		
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera															
Tasa de interés															
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,359			3,350			3,349			3,348			3,351		
* Datos preliminares															
** Datos preliminares para el último día															