

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

| | 11 octubre | 12 octubre | 13 octubre | 14 octubre | 15 octubre |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 891,0 | 495,6 | 82,3 | 17,9 | 92,2 |
| 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 | 100,0 | 100,0 | 290,0 | 80,0 | 65,0 |
| Plazo de vencimiento | 262,0 | 230,7 | 295,5 | 143,0 | 135,4 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1 año | 9 meses | 7 días | 14 meses | 1 mes |
| Saldo | 4,45/4,60/4,54 | 4,18/4,25/4,21 | 2,90/3,14/3,09 | 4,69/4,92/4,84 | 3,10/3,19/3,18 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (19 de Octubre de 2004) | 7 015,3 | 7 300,3 | 2,91/3,08/3,05 | 3,04/3,13/3,08 | 7 300,3 |
| Vencimientos de CDBCRP del 15 Octubre de 2004 | | | 7 300,3 | 7 230,3 | 7 230,3 |
| | | | 70,0 | 70,0 | 290,0 |
| | | | 70,0 | | 620,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| 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 | 150,5 | 99,3 | 66,4 | 33,3 | 66,3 |
| i. Compras (millones de US\$) | 45,5 | 30,0 | 20,0 | 10,0 | 20,0 |
| Tipo de cambio promedio | 3,3081 | 3,3087 | 3,3175 | 3,3293 | 3,3170 |
| 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 | 551,5 | 309,9 | 148,6 | 51,2 | 158,5 |
| 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) | 0,0106% | 0,0106% | 0,0106% | 0,0106% | 0,0106% |
| 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 | 2,25% | 147,5 | 49,0 | 10,0 | 71,0 |
| | | 2,25% | 2,25% | 2,25% | 2,25% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 551,5 | 162,4 | 99,6 | 41,2 | 87,5 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 1 150,7 | 1 130,7 | 1 109,0 | 1 086,1 | 1 069,4 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,7 | 7,6 | 7,5 | 7,3 | 7,2 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 402,5 | 382,5 | 360,7 | 337,9 | 321,2 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,7 | 2,6 | 2,4 | 2,3 | 2,2 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 167,5 | 87,5 | 244,5 | 347,4 | 324,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 2,60/2,95/2,77 | 2,70/2,90/2,77 | 2,85/2,95/2,90 | 2,90/3,00/2,93 | 2,90/3,00/2,99 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera | 29,1 | 7,0 | 22,5 | 21,0 | 31,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 1,65/1,77/1,76 | 1,75/1,81/1,79 | 1,76/1,77/1,77 | 1,66/1,77/1,68 | 1,70/1,82/1,75 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 20,0 | 30,5 | 18,0 | 62,5 | 133,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | 5,0 / 3,75 | | 4,0 / 3,07 | | 6,0 / 4,30 |
| 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 | 19,1 | -29,0 | -26,5 | 32,1 | -6,5 |
| Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f | -27,7 | -33,2 | 0,9 | 65,9 | 7,7 |
| a. Mercado spot con el público (**) | 13,2 | -0,4 | 16,5 | 62,2 | 28,3 |
| i. Compras | 61,4 | 34,7 | 48,0 | 129,8 | 74,7 |
| ii. (-) Ventas | 48,2 | 35,1 | 31,6 | 67,6 | 46,4 |
| b. Compras forward al público (con y sin entrega) (**) | 24,0 | 3,9 | -4,3 | -16,8 | -0,9 |
| i. Pactadas | 24,0 | 4,6 | 2,8 | 5,9 | 4,2 |
| ii. (-) Vencidas | 0,0 | 0,7 | 7,1 | 22,7 | 5,1 |
| c. Ventas forward al público (con y sin entrega) (**) | -22,8 | -0,3 | 23,1 | 17,0 | 13,4 |
| i. Pactadas | 5,1 | 20,2 | 26,1 | 22,5 | 23,6 |
| ii. (-) Vencidas | 27,8 | 20,5 | 3,0 | 5,6 | 10,1 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias (**) | | | | | |
| i. Al contado | 99,1 | 85,0 | 131,0 | 125,1 | 106,5 |
| ii. A futuro | 13,2 | 7,0 | 7,0 | 4,0 | 1,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**) | 26,5 | 20,0 | 0,4 | -17,5 | 9,0 |
| i. Compras | 26,5 | 20,0 | 2,4 | 4,0 | 9,5 |
| ii. (-) Ventas | 0,0 | 0,0 | 2,0 | 21,5 | 0,5 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -39,5 | -33,0 | -20,0 | 4,0 | -24,5 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3,311 | 3,307 | 3,313 | 3,325 | 3,319 |
| * Datos preliminares | | | | | |
| ** Datos preliminares para el último día | | | | | |