

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

	25 octubre	26 octubre	27 octubre	28 octubre	29 octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	221,3	233,8	22,7	63,3	-58,2
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)	60,0 90,0	30,0 40,0 50,0			
Propuestas recibidas	114,5 174,0	99,0 99,2 103,2			
Plazo de vencimiento	18 meses 1 año	2 años 7 meses 7 días			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	5,20/5,32/5,27 4,51/4,69/4,63	5,80/5,95/5,88 4,03/4,24/4,17 3,09/3,15/3,13			
Saldo	7 425,4	7 385,4	7 385,4	7 385,4	7 385,4
Próximo vencimiento de CDBCRP (2 de Noviembre de 2004)	160,0	50,0	50,0	50,0	50,0
Vencimientos de CDBCRP el 29 de Octubre de 2004	160,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de RTP			120,0	100,0 20,0	145,0 20,0
Propuestas recibidas			174,1	249,5 25,0	170,5 85,5
Plazo de vencimiento			1 día	4 días 4 días	1 día 1 día
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			3,02/3,10/3,07	3,03/3,11/3,08 2,97/3,05/3,02	3,05/3,10/3,08 3,10/3,10/3,10
Saldo			120,0	120,0	165,0
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	48,1	0,0	16,6	6,7	16,6
i. Compras (millones de US\$)	14,5		5,0	2,0	5,0
Tipo de cambio promedio	3,3182		3,3179	3,3250	3,3266
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	119,4	113,8	159,3	189,9	123,4
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)	0,0106%	0,0106%	0,0106%	0,0106%	0,0110%
b. Compra temporal de CDBCRP y RTP (fuera de subasta)					
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	25,0	0,0	0,0	0,0	10,0
Tasa de interés	2,25%	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	94,4	113,8	159,3	189,9	113,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	986,3	981,5	976,7	977,3	966,1
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	6,5	6,5	6,5	6,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	238,0	233,2	230,5	229,0	217,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	1,6	1,5	1,5	1,4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	285,1	239,5	248,2	253,3	224,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3,00/3,00/3,00	3,00/3,10/3,04	3,00/3,10/3,07	2,80/3,10/3,06	3,05/3,10/3,10
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	17,0	13,5	20,0	18,0	7,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,77/1,78/1,77	1,67/1,77/1,72	1,65/1,76/1,69	1,70/1,82/1,78	1,60/1,85/1,79
c. Total mercado secundario de CDBCRP	26,5	36,0	19,2	14,5	31,0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		4,0 / 3,95	4,2 / 4,00		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	3,5 / 4,48	2,0 / 4,57			
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	-16,5	27,3	10,5	3,8	0,4
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	-16,5	22,6	4,2	-1,4	6,2
a. Mercado spot con el público (**)	1,1	17,1	16,3	22,2	1,4
i. Compras	46,4	60,4	73,5	63,5	62,1
ii. (-) Ventas	45,2	43,2	57,2	41,4	60,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega) (**)	-4,4	5,7	-2,4	-5,6	-6,5
i. Pactadas	0,6	5,7	8,5	24,0	1,0
ii. (-) Vencidas	5,0	0,0	10,9	29,6	7,5
c. Ventas forward al público (con y sin entrega) (**)	-4,4	1,0	-8,8	-10,7	-0,8
i. Pactadas	2,1	35,0	14,3	13,1	10,1
ii. (-) Vencidas	6,5	34,1	23,1	23,8	10,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)					
i. Al contado	78,2	108,5	83,0	84,2	113,8
ii. A futuro	5,6	7,0	3,0	0,0	3,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	1,2	34,0	13,0	-14,8	5,6
i. Compras	6,2	34,0	23,0	13,5	10,8
ii. (-) Ventas	5,0	0,0	10,0	28,3	5,2
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-17,3	5,5	-13,0	-14,5	2,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatrec)	3,314	3,322	3,319	3,324	3,324
* Datos preliminares ** Datos preliminares para el último día					