

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

CIRCULAR No. 016-2004-EF/90

Lima, 2 de setiembre del 2004

Ref. Reglamento Operativo del Sistema de Liquidación Bruta en Tiempo Real

El Directorio del Banco Central de Reserva del Perú ha dispuesto modificar el artículo 21° y el Anexo 2 del Reglamento Operativo del Sistema de Liquidación Bruta en Tiempo Real (Sistema LBTR) aprobado mediante la Circular No. 026-2001-EF/90, estableciendo que las operaciones en moneda extranjera también puedan efectuarse con recursos obtenidos mediante Operaciones Intradiarias de Compra Temporal de Activos Financieros en moneda nacional. Dichos activos financieros en Nuevos Soles serán valorizados en Dólares de los Estados Unidos de América, al 90% del tipo de cambio compra de la Superintendencia de Banca y Seguros del día útil previo:

“Artículo 21

Las operaciones en moneda nacional pueden efectuarse con Fondos Propios en dicha moneda y con recursos obtenidos mediante Operaciones Intradiarias de Compra Temporal de Activos Financieros en moneda nacional o en moneda extranjera. Asimismo, las operaciones en moneda extranjera pueden efectuarse con Fondos Propios en moneda extranjera y con recursos obtenidos mediante Operaciones Intradiarias de Compra Temporal de Activos Financieros en moneda nacional o en moneda extranjera.”

“ANEXO 2

VALORIZACIÓN DE LOS ACTIVOS FINANCIEROS ACEPTABLES PARA EFECTUAR OPERACIONES INTRADIARIAS DE COMPRA TEMPORAL DE ACTIVOS EN MONEDA NACIONAL

Activo Financiero	Valorización
Dólares de los Estados Unidos De América	95% de su valor en Nuevos Soles aplicando el tipo de cambio compra de la SBS del día útil previo.
Certificado de Depósito del BCRP y Bonos del Tesoro Público en moneda nacional.	Al precio mínimo aceptado en cada subasta de colocación primaria o, de ser el caso, a un precio representativo de mercado, pudiendo ser exigido un margen adicional para cubrir posibles fluctuaciones en el precio de mercado de los valores a comprar.
Bonos del Tesoro Público en moneda extranjera.	Al precio mínimo aceptado en cada subasta de colocación primaria o, de ser el caso, a un precio representativo de mercado, pudiendo ser exigido un margen adicional para cubrir posibles fluctuaciones en el precio de mercado de los valores a comprar. Dichos activos financieros en Dólares de los Estados Unidos de América serán valorizados en Nuevos Soles, al 95% del tipo de cambio compra de la Superintendencia de Banca y Seguros del día útil previo.
Otros valores que el BCRP apruebe.	De acuerdo con las condiciones que el BCRP establezca.

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

VALORIZACIÓN DE LOS ACTIVOS FINANCIEROS ACEPTABLES PARA EFECTUAR OPERACIONES INTRADIARIAS DE COMPRA TEMPORAL DE ACTIVOS EN MONEDA EXTRANJERA

Activo Financiero	Valorización
Certificado de Depósito del BCRP y Bonos del Tesoro Público en moneda nacional.	Al precio mínimo aceptado en cada subasta de colocación primaria o, de ser el caso, a un precio representativo de mercado, pudiendo ser exigido un margen adicional para cubrir posibles fluctuaciones en el precio de mercado de los valores a comprar. Dichos activos financieros en Nuevos Soles serán valorizados en Dólares de los Estados Unidos de América, al 90% del tipo de cambio compra de la Superintendencia de Banca y Seguros del día útil previo.
Bonos del Tesoro Público en moneda extranjera.	Al precio mínimo aceptado en cada subasta de colocación primaria o, de ser el caso, a un precio representativo de mercado, pudiendo ser exigido un margen adicional para cubrir posibles fluctuaciones en el precio de mercado de los valores a comprar
Otros valores que el BCRP apruebe.	De acuerdo con las condiciones que el BCRP establezca.

Renzo Rossini Miñán
Gerente General (e)