

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

| | 16 febrero | 17 febrero | 18 febrero | 19 febrero | 20 febrero |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR | 12,0 | -21,0 | -96,1 | -121,7 | -116,8 |
| 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 (CDBCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | | | | | |
| Saldo | 5 543,6 | 5 543,6 | 5 543,6 | 5 488,6 | 5 488,6 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (8 de marzo de 2004) | | | | | 95,6 |
| Vencimientos de CDBCRP el 20 de febrero de 2004 | | | | | 0,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP | 110,0 | 155,0 | 225,0 | 140,0 | 205,0 |
| Propuestas recibidas | 310,0 | 350,0 | 278,0 | 246,0 | 286,0 |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| 1 día | | | | | 3 días |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio | 2,52/2,57/2,54 | 2,54/2,60/2,57 | 2,44/2,56/2,51 | 2,46/2,51/2,48 | 2,48/2,50/2,49 |
| Saldo | 110,0 | 155,0 | 225,0 | 140,0 | 205,0 |
| 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 | 0,0 | 1,7 | 34,7 | 69,5 | 33,0 |
| i. Compras (millones de US\$) | | 0,5 | 10,0 | 20,0 | 9,5 |
| Tipo de cambio promedio | | 3,4730 | 3,4727 | 3,4731 | 3,4745 |
| 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 | 122,0 | 135,7 | 163,6 | 87,8 | 121,2 |
| 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) | 0,0101% | 0,0101% | 0,0101% | 0,0101% | 0,0092% |
| b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 1,75% | 1,75% | 1,75% | 1,75% | 1,75% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones | 122,0 | 135,7 | 163,6 | 80,8 | 83,2 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 1 005,9 | 998,3 | 993,1 | 984,2 | 976,2 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,1 | 7,0 | 7,0 | 6,9 | 6,9 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 264,4 | 256,9 | 251,7 | 242,7 | 234,7 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1,9 | 1,8 | 1,8 | 1,7 | 1,6 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 165,0 | 142,5 | 142,0 | 259,1 | 264,4 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 2,50/2,60/2,54 | 2,50/2,55/2,53 | 2,10/2,55/2,47 | 2,50/2,60/2,52 | 2,45/2,55/2,53 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera | 0,0 | 13,0 | 0,0 | 8,8 | 17,0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | | 1,00/1,05/1,02 | | 0,95/1,00/0,95 | 0,94/1,10/0,95 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP | 0,5 | | 46,4 | 30,0 | 20,0 |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) | | | 12,4 / 3,02 | | |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) | 0,5 / 3,30 | | 12,0 / 3,27 | 8,0 / 3,27 | |
| 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 | -5,5 | -31,5 | 8,1 | -2,8 | 4,5 |
| Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f | -6,6 | -8,9 | 15,4 | 5,6 | -18,3 |
| a. Mercado spot con el público (**) | -3,1 | -5,2 | 20,7 | 18,1 | -12,0 |
| i. Compras | 55,2 | 52,6 | 74,3 | 61,4 | 41,2 |
| ii. (-) Ventas | 58,2 | 57,8 | 53,6 | 43,2 | 53,2 |
| b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**) | 5,6 | -3,8 | 8,2 | -53,6 | 40,5 |
| i. Pactadas | 12,0 | 19,3 | 10,8 | 0,5 | 53,3 |
| ii. (-) Vencidas | 6,4 | 23,2 | 2,5 | 54,0 | 12,8 |
| c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**) | 4,5 | 18,8 | 15,5 | -45,2 | 17,7 |
| i. Pactadas | 19,6 | 49,7 | 36,3 | 17,3 | 30,3 |
| ii. (-) Vencidas | 15,1 | 30,9 | 20,8 | 62,5 | 12,6 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias (**) | | | | | |
| i. Al contado | 60,6 | 91,5 | 70,4 | 120,1 | 62,1 |
| ii. A futuro | 0,0 | 14,0 | 2,0 | 4,0 | 18,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**) | 8,1 | 5,5 | 20,0 | 8,5 | 0,0 |
| i. Compras | 10,1 | 23,0 | 20,0 | 62,5 | 0,0 |
| ii. (-) Ventas | 2,0 | 17,5 | 0,0 | 54,0 | 0,0 |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | -3,0 | -1,5 | -7,0 | -12,5 | -6,5 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio | 3,481 | 3,476 | 3,473 | 3,473 | 3,475 |
| * Datos preliminares | | | | | |
| ** Datos preliminares para el último día | | | | | |