

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ
OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millions S/.)

	12 setiembre	13 setiembre	14 setiembre	15 setiembre	16 setiembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR	499,0	346,7	74,9	121,6	171,8
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)	<u>20,0</u> 1/	<u>20,0</u> 2/	<u>10,5</u> 1/	<u>10,5</u> 2/	<u>20,0</u> 1/
Propuestas recibidas	61,0	61,0	10,5	10,5	37,0
Plazo de vencimiento	2 años	2 años	3 años	3 años	2 años
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	4.78/4.89/4.84	4.13/4.16/4.15	5.50/5.55/5.50	5.50/5.55/5.50	4.90/4.90/4.90
Saldo	12,0	40,0			10 030,2
Próximo vencimiento de CDBCRP (14 de setiembre de 2005)					444,9
Vencimientos de CDBCRP del 14 al 16 de setiembre de 2005	64,0	76,0			504,9
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>100,0</u>	<u>60,0</u>	<u>0,0</u>
Propuestas recibidas			169,0	101,0	
Plazo de vencimiento			1 día	1 día	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			3.05/3.05/3.05	2.95/2.95/2.95	2.95/3.00/2.97
Saldo					
Próximo vencimiento					
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDBCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	<u>32,9</u>	<u>9,9</u>	<u>3,3</u>	<u>1,6</u>	<u>0,0</u>
i. Compras (millones de US\$)	10,0	3,0	1,0	0,5	
Tipo de cambio promedio	3,2850	3,2885	3,2900	3,2950	
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	279,8	206,6	208,2	172,7	171,8
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)	0,0046%	0,0046%	0,0046%	0,0046%	0,0036%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%	3,75%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<u>35,0</u>	<u>46,5</u>	<u>25,0</u>	<u>0,0</u>	<u>13,0</u>
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	244,8	160,1	183,2	172,7	158,8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	1 457,7	1 432,6	1 412,8	1 394,8	1 378,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	8,1	7,9	7,7	7,6	7,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	486,3	461,2	441,3	423,4	406,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,7	2,5	2,4	2,3	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>129,0</u>	<u>169,0</u>	<u>378,3</u>	<u>326,5</u>	<u>272,1</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.90/3.00/2.95	2.95/3.00/2.97	2.95/3.05/3.00	2.95/3.05/3.00	3.00/3.05/3.01
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>29,0</u>	<u>29,0</u>	<u>29,0</u>	<u>33,0</u>	<u>33,5</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3.22/3.57/3.52	3.55/3.57/3.57	3.55/3.57/3.57	3.50/3.57/3.55	3.55/3.60/3.59
c. Total mercado secundario de CDBCRP	<u>78,0</u>	<u>41,0</u>	<u>6,0</u>	<u>14,0</u>	<u>28,0</u>
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			1,0/4.05	2,0/4.05	2,0/3.70
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	-23,7	29,9	-12,0	49,6	-32,8
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	-32,6	35,4	-20,8	15,0	-29,7
a. Mercado spot con el público (**)	<u>0,0</u>	<u>27,3</u>	<u>-7,2</u>	<u>9,2</u>	<u>-20,8</u>
i. Compras	61,2	77,1	69,7	83,7	58,5
ii. (-) Ventas	61,1	49,8	76,9	74,5	79,3
b. Compras forward al público (con y sin entrega) (**)	<u>13,1</u>	<u>19,2</u>	<u>19,2</u>	<u>7,3</u>	<u>58,4</u>
i. Pactadas	20,6	41,9	24,7	66,5	89,1
ii. (-) Vencidas	7,5	18,2	5,5	59,2	30,7
c. Ventas forward al público (con y sin entrega) (**)	<u>4,2</u>	<u>29,2</u>	<u>10,4</u>	<u>-27,4</u>	<u>61,6</u>
i. Pactadas	35,6	29,3	27,4	11,1	92,0
ii. (-) Vencidas	31,4	0,1	17,0	38,5	30,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)					
i. Al contado	48,8	86,6	69,8	65,0	101,5
ii. A futuro	1,0	17,0	6,0	12,1	7,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	<u>1,2</u>	<u>-13,0</u>	<u>1,0</u>	<u>-23,9</u>	<u>-2,0</u>
i. Compras	8,6	0,0	2,0	29,1	4,0
ii. (-) Ventas	7,3	13,0	1,0	53,0	6,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	<u>-10,0</u>	<u>3,0</u>	<u>-3,0</u>	<u>9,0</u>	<u>-7,2</u>
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,284	3,291	3,289	3,294	3,296
* Datos preliminares					
** Datos preliminares para el último día					

1/ Estos CD BCRP se emiten al siguiente día útil.

2/ Estos CD BCRP se subastaron el día útil previo.