

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

	02 Diciembre	03 Diciembre	04 Diciembre	05 Diciembre	06 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	103,5	258,9	230,2	263,2	249,7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: mínima/ máxima/ promedio					
Saldo de CDBCRP	1 745,3	1 745,3	1 745,3	1 745,3	1 715,3
Próximo vencimiento de CDBCRP (9 de diciembre del 2002)					105,0
Vencimientos de CDBCRP del 9 al 13 de diciembre del 2002					385,2
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP	<u>125,0</u>	<u>50,0</u>	<u>60,0</u>	<u>60,0</u>	<u>45,0</u>
Propuestas recibidas	253,7	120,0	140,4	101,5	94,3
Plazo de vencimiento	1 día	7 días	1 día	1 día	3 días
Tasas de interés: mínima/ máxima/ promedio	3,83 / 3,83 / 3,83	3,73 / 4,15 / 4,06	4,06 / 4,06 / 4,06	3,96 / 4,32 / 3,97	3,86 / 4,06 / 3,90
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: mínima/ máxima/ promedio					
Saldo nominal de CDR BCRP	319,0	319,0	319,0	319,0	319,0
Saldo reajustado de CDR BCRP	308,9	311,1	312,2	310,8	309,7
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP					
i. Compras (equivalente en millones de S/.)					
Monto (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (equivalente en millones de S/.)					
Monto (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP antes del cierre de operaciones	278,5	318,9	315,2	323,2	314,7
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,01000%	0,00990%	0,00990%	0,00990%	0,00900%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%	4,50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%	4,50%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones	278,5	318,9	315,2	323,2	297,7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	811,2	857,7	880,0	895,0	900,8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,2	6,6	6,8	6,9	6,9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	179,4	225,9	248,2	263,2	269,0
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,7	1,9	2,0	2,1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	<u>239,1</u>	<u>145,8</u>	<u>153,5</u>	<u>185,3</u>	<u>246,5</u>
Tasas de interés: mínima/ máxima/ promedio	3,70 / 4,10 / 3,97	4,05 / 4,35 / 4,17	3,95 / 4,25 / 4,19	3,80 / 4,25 / 3,95	3,50 / 4,00 / 3,77
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	<u>107,5</u>	<u>117,8</u>	<u>138,8</u>	<u>127,8</u>	<u>113,8</u>
Tasas de interés: mínima/ máxima/ promedio	1,42 / 2,25 / 2,05	1,29 / 2,21 / 1,99	1,29 / 2,27 / 2,02	1,30 / 2,28 / 2,06	1,60 / 2,37 / 2,28
c. Mercado secundario de CDBCRP					
Tasas de interés (rendimiento para el comprador): mínima/ máxima/ 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	-20,8	-7,5	8,5	-8,6	15,5
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	2,2	-5,1	16,1	-18,1	19,7
a. Mercado spot con el público (**)	<u>8,3</u>	<u>-2,0</u>	<u>12,4</u>	<u>-14,3</u>	<u>19,9</u>
i. Compras	82,3	56,0	67,4	46,4	49,1
ii. (-) Ventas	74,0	58,0	55,0	60,7	29,2
b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)	<u>-14,1</u>	<u>2,6</u>	<u>9,8</u>	<u>1,0</u>	<u>-5,1</u>
i. Pactadas	48,9	9,0	15,2	1,0	10,9
ii. (-) Vencidas	63,0	6,4	5,5		16,0
c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)	<u>8,9</u>	<u>5,1</u>	<u>17,4</u>	<u>-8,5</u>	<u>-0,9</u>
i. Pactadas	42,0	25,4	33,0	8,5	22,1
ii. (-) Vencidas	33,1	20,3	15,6	17,0	23,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)					
i. Al contado	136,0	159,6	142,8	112,2	90,6
ii. A futuro	11,0	11,0	5,0	5,0	0,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	<u>-36,0</u>	<u>10,9</u>	<u>13,8</u>	<u>13,2</u>	<u>6,8</u>
i. Compras	67,5	15,9	13,9	14,2	22,5
ii. (-) Ventas	23,5	5,0	0,1	1,0	15,7
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	<u>100,0</u>	<u>100,0</u>	<u>100,0</u>	<u>100,0</u>	<u>100,0</u>
Tasa de interés	2,47%	2,47%	2,47%	2,46%	2,46%
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,517	3,545	3,552	3,538	3,525
* Datos preliminares					
** Datos preliminares para el último día					