

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

| | 15 Julio | 16 Julio | 17 Julio | 18 Julio | 19 Julio |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 265,1 | 174,8 | 61,4 | -7,7 | -134,1 |
| 2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones | | | | | |
| a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCRP</u> | | | | | |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | 114,5 | -- | -- | -- | -- |
| Propuestas aceptadas | 30,0 | -- | -- | -- | -- |
| Plazo de vencimiento | 5 meses | -- | -- | -- | -- |
| Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | -- | -- | -- | -- | -- |
| Máxima | -- | -- | -- | -- | -- |
| Promedio | -- | -- | -- | -- | -- |
| Saldo de CDBCRP | 2 070,2 | 1 970,2 | 1 970,2 | 1 970,2 | 1 970,2 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (23 de julio del 2002) | | | | | 65,0 |
| Vencimientos de CDBCRP el 19 de julio de 2002 | | | | | 150,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP | | | | | |
| Propuestas recibidas | -- | 170,2 | 219,7 | 205,0 | 461,7 |
| Propuestas aceptadas | -- | 65,0 | 140,0 | 185,0 | 300,0 |
| Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | -- | 3,00% | 2,87% | 2,76% | 2,69% |
| Máxima | -- | 3,06% | 2,97% | 2,96% | 2,96% |
| Promedio | -- | 3,04% | 2,94% | 2,85% | 2,77% |
| b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP</u> | | | | | |
| 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 | | | | | |
| a. Antes de operaciones de compra temporal de CDBCRP y de BTP | 235,1 | 175,9 | 61,4 | -7,7 | -134,1 |
| b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP | 235,1 | 240,9 | 201,4 | 177,3 | 165,9 |
| 4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S./)</u> | -- | -- | -- | -- | -- |
| Monto (millones de US\$) | -- | -- | -- | -- | -- |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,00430% | 0,00430% | 0,00430% | 0,00430% | 0,00430% |
| b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u> | | | | | |
| Monto (millones de S./) | 56,4 | -- | -- | -- | -- |
| Tasa de interés | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u> | | | | | |
| Monto (millones de S./) | -- | -- | -- | -- | -- |
| Tasa de interés | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% | 3,25% |
| d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u> | | | | | |
| Monto (millones de S./) | 105,0 | 40,0 | 2,2 | -- | -- |
| Tasa de interés | 1,90% | 1,90% | 1,90% | 1,90% | 1,90% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones | 186,5 | 200,9 | 199,2 | 177,3 | 165,9 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S./) (*) | 932,0 | 925,1 | 919,1 | 914,4 | 909,5 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 7,1 | 7,1 | 7,0 | 7,0 | 7,0 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S./) | 310,7 | 303,9 | 297,7 | 291,0 | 284,4 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 2,4 | 2,3 | 2,3 | 2,2 | 2,2 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u> | | | | | |
| i. Monto | 239,5 | 300,6 | 267,3 | 242,0 | 237,0 |
| ii. Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 3,05% | 2,90% | 2,85% | 2,70% | 2,50% |
| Máxima | 3,75% | 3,75% | 3,60% | 3,00% | 3,50% |
| Promedio | 3,14% | 3,03% | 3,01% | 2,90% | 2,87% |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u> | | | | | |
| i. Monto | 34,8 | 24,8 | 3,8 | 7,8 | 10,8 |
| ii. Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 1,90% | 1,90% | 1,90% | 1,51% | 1,86% |
| Máxima | 3,00% | 3,00% | 1,95% | 2,00% | 1,95% |
| Promedio | 2,17% | 2,21% | 1,94% | 1,84% | 1,90% |
| c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u> | | | | | |
| i. Monto | -- | 6,0 | 5,0 | 2,0 | -- |
| ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador) | | | | | |
| Mínima | -- | 2,98% | 3,25% | 4,15% | -- |
| Máxima | -- | 2,98% | 4,50% | 4,15% | -- |
| Promedio | -- | 2,98% | 4,17% | 4,15% | -- |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | | | | | |
| a. <u>Flujo de la posición de cambios (**)</u> | | | | | |
| i. Compras al contado al público | 113,3 | 112,8 | 114,7 | 129,5 | 143,0 |
| ii. Ventas al contado al público | 68,1 | 100,9 | 67,3 | 69,0 | 117,0 |
| iii. Compras a futuro pactadas con el público | 12,0 | 22,9 | 17,9 | 22,4 | 47,0 |
| iv. Ventas a futuro pactadas con el público | 55,1 | 61,0 | 45,5 | 92,4 | 51,9 |
| v. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público | 14,4 | 31,5 | 7,9 | 14,5 | 54,8 |
| vi. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público | 46,1 | 24,0 | 31,9 | 69,4 | 39,7 |
| b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u> | | | | | |
| i. Al contado | 56,0 | 70,4 | 62,7 | 43,5 | 105,3 |
| ii. A futuro | 8,0 | 7,0 | 13,0 | 2,0 | 10,0 |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u> | | | | | |
| i. Monto | -- | -- | -- | -- | -- |
| ii. Tasa de interés | -- | -- | -- | -- | -- |

* Datos preliminares

** Datos preliminares para el último día