

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

	30 Setiembre	1 Octubre	2 Octubre	03 Octubre	04 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-180,2	-178,2	-259,3	-172,1	-174,4
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	--	--	--	--	--
Propuestas aceptadas	--	--	--	--	--
Plazo de vencimiento	--	--	--	--	--
Tasas de interés					
Mínima	--	--	--	--	--
Máxima	--	--	--	--	--
Promedio	--	--	--	--	--
Saldo de CDBCRP	1 735,2	1 735,2	1 735,2	1 735,2	1 735,2
Próximo vencimiento de CDBCRP (9 de octubre del 2002)					90,0
Vencimientos de CDBCRP del 9 al 11 de octubre de 2002					140,0
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP					
Propuestas recibidas	299,7	426,2	703,2	637,2	697,2
Propuestas aceptadas	190,0	330,0	380,0	325,0	350,0
Plazo	1 día	1 día	1 día	1 día	5 días
Tasas de interés					
Mínima	6,18%	5,75%	5,76%	5,00%	5,36%
Máxima	7,52%	7,45%	6,37%	5,91%	6,53%
Promedio	6,81%	6,62%	5,89%	5,45%	5,75%
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCRP (CDRBCRP)					
Propuestas aceptadas	30,0	18,2	--	--	--
Plazo de vencimiento	6 meses	6 meses	--	--	--
Tasa de interés promedio	2,49%	2,44%	--	--	--
Saldo nominal de CDR BCRP	217,8	236,0	236,0	236,0	236,0
Saldo reajustado de CDR BCRP	218,5	235,7	235,6	236,2	235,1
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	-210,2	-196,4	-259,3	-172,1	-174,4
b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP	-20,2	133,6	120,7	152,9	175,6
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>	21,5	--	--	--	--
Monto (millones de US\$)	5,9	--	--	--	--
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,00690%	0,00690%	0,00690%	0,00690%	0,00860%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>					
Monto (millones de S/.)	49,7	60,0	60,0	60,0	60,0
Tasa de interés	7,58%	6,52%	6,22%	5,79%	6,38%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Monto (millones de S/.)	10,3	--	--	--	--
Tasa de interés	7,58%	--	--	--	--
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>					
Monto (millones de S/.)	--	--	--	--	--
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	61,3	193,6	180,7	212,9	235,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	839,2	820,2	813,7	822,3	832,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,4	6,3	6,3	6,4	6,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	190,1	193,6	187,1	196,7	205,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,5	1,5	1,5	1,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>					
i. Monto	135,8	136,5	215,0	168,5	174,5
ii. Tasas de interés					
Mínima	5,50%	6,00%	5,70%	5,60%	5,75%
Máxima	8,00%	7,00%	6,65%	6,40%	6,75%
Promedio	7,58%	6,52%	6,22%	5,79%	6,38%
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>					
i. Monto	5,0	31,5	15,0	2,0	33,0
ii. Tasas de interés					
Mínima	1,50%	1,63%	1,60%	1,85%	1,82%
Máxima	1,50%	1,63%	1,60%	1,85%	2,15%
Promedio	1,50%	1,63%	1,60%	1,85%	2,02%
c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>					
i. Monto	--	--	17,0	0,5	22,4
ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador)					
Mínima	--	--	4,16%	6,50%	3,65%
Máxima	--	--	6,25%	6,50%	4,94%
Promedio	--	--	4,96%	6,50%	4,38%
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	81,2	66,6	62,0	54,6	58,7
ii. Ventas al contado al público	82,2	81,1	71,7	74,3	77,1
iii. Compras a futuro pactadas con el público	3,5	0,9	3,0	10,9	0,4
iv. Ventas a futuro pactadas con el público	50,3	19,9	36,8	23,8	40,4
v. Compras por vencimientos de forwards sin entrega y por swaps	43,2	13,7	22,2	29,5	62,5
vi. Ventas por vencimientos de forwards sin entrega y por swaps	1,5	0,0	2,5	2,5	20,1
vii. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público	0,7	4,0	1,0	3,2	23,7
viii. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público	46,8	16,2	23,0	31,9	68,3
b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>					
i. Al contado	90,4	93,5	103,4	86,7	111,7
ii. A futuro	16,0	5,9	5,2	10,5	2,0
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
i. Monto	--	--	--	--	--
ii. Tasa de interés	--	--	--	--	--

* Datos preliminares

** Datos preliminares para el último día