

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

	06 Enero	07 Enero	08 Enero	09 Enero	10 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	285,4	426,7	348,6	335,9	338,5
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCRP</u>					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP)</u>					
Propuestas recibidas		75,0 75,0	50,0 50,0	35,0	50,0
Plazo de vencimiento		191,5 275,0	267,5 274,7	227,0	239,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		3 meses 6 meses	9 meses 18 meses	1 año	18 meses
Saldo de CDBCRP	1 635,1	3,35/3,75/3,51 3,82/4,05/4,01	4,05/4,10/4,08 5,37/5,87/5,65	4,47/4,67/4,52	5,25 / 5,60 / 5,45
Próximo vencimiento de CDBCRP (15 de enero del 2003)		1 785,1	1 885,1	1 920,1	1 970,1
Vencimientos de CDBCRP del 13 al 17 de enero de 2003			25,0	25,0	
				25,0	
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>	45,0				
Propuestas recibidas	108,0				
Plazo de vencimiento	1 día				
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,43 / 3,43 / 3,43				
iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCRP (CDR BCRP)</u>					
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	307,6	307,2	306,8	306,5	306,9
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP</u>					
i. <u>Compras (equivalente en millones de S/.)</u>					
Monto (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. <u>Ventas (equivalente en millones de S/.)</u>					
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	330,4	276,7	248,6	300,9	288,5
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,00910%	0,00810%	0,00810%	0,00810%	0,00820%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	4,50%	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	4,50%	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	112,0	0,0			
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	218,4	276,7	248,6	300,9	288,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	918,7	925,7	927,4	934,5	945,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,8	6,9	6,9	7,0	7,0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	227,9	234,9	236,6	243,8	254,9
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,8	1,8	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	129,9	208,5	159,5	179,4	138,1
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,35/ 3,70 / 3,55	3,50/3,70/3,60	3,55/3,95/3,86	3,70/3,90/3,82	3,50/3,95/3,66
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>	132,0	140,0	120,0	123,8	123,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,60 / 2,71 / 2,35	1,10/2,71/2,27	1,60/2,71/2,39	1,30/2,71/2,28	1,30/2,71/2,30
c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>		1,0			15,0
Tasas de interés (rendimiento para el comprador): Mínima / Máxima / Promedio		3,85/3,85/3,85			3,80/3,80/3,80
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f	13,7	-20,5	-2,4	-8,5	26,9
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	-6,2	-13,3	0,4	-17,3	20,7
a. <u>Mercado spot con el público (**)</u>	-3,3	-11,0	-3,4	-18,6	19,8
i. <u>Compras</u>	70,2	54,8	46,4	71,3	77,4
ii. (-) <u>Ventas</u>	73,5	65,8	49,8	89,9	57,6
b. <u>Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>	16,3	-17,1	0,5	0,1	1,0
i. <u>Pactadas</u>	16,5	0,6	5,0	46,1	1,0
ii. (-) <u>Vencidas</u>	0,2	17,7	4,5	46,0	
c. <u>Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>	-3,6	-10,0	3,4	-8,6	-5,2
i. <u>Pactadas</u>	14,5	30,0	19,1	32,7	31,9
ii. (-) <u>Vencidas</u>	18,1	40,0	15,7	41,3	37,1
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>					
i. <u>Al contado</u>	75,0	56,9	96,2	76,8	91,4
ii. <u>A futuro</u>	3,0	2,0	6,0	3,0	11,5
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)</u>	15,0	20,5	15,5	-3,4	34,0
i. <u>Compras</u>	15,0	32,5	15,5	42,6	34,0
ii. (-) <u>Ventas</u>		12,0		46,0	
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>		-0,5	-0,5		4,0
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>		0,0			
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,501	3,496	3,492	3,488	3,493
* Datos preliminares		** Datos preliminares para el último día			