

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

| | 20 Enero | 21 Enero | 22 Enero | 23 Enero | 24 Enero |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 105,7 | 105,7 | 74,7 | 56,3 | -95,7 |
| 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 | 2 090,1 | 2 090,1 | 2 090,1 | 2 090,1 | 2 090,1 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (27 de enero del 2003) | | | | | |
| Vencimientos de CDBCRP del 27 al 31 de enero de 2003 | | | | | |
| ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP | 25,1 | 30,0 | 105,0 | 10,0 | 230,0 |
| Propuestas recibidas | 131,2 | 160,8 | 266,0 | 40,0 | 485,7 |
| Plazo de vencimiento | 1 día | 1 día | 1 día | 1 día | 3 días |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 3,68/3,98/3,74 | 4,03/4,06/4,05 | 3,76/3,93/3,87 | 3,86/3,86/3,86 | 3,74/3,86/3,80 |
| 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 | 236,0 | 236,0 | 236,0 | 236,0 | 236,0 |
| Saldo reajustado de CDR BCRP | 226,9 | 227,3 | 227,7 | 227,4 | 227,2 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP (28 de Febrero del 2003) | 70,0 | 70,0 | 70,0 | 70,0 | 70,0 |
| 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 al cierre de operaciones | 130,8 | 162,1 | 189,7 | 136,3 | 134,3 |
| 4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.) | | 8,0 | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,00810% | 0,00810% | 0,00810% | 0,00820% | 0,00820% |
| b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta) | | 4,1 | | | |
| Tasa de interés | 4,25% | 4,25% | 4,25% | 4,25% | 4,25% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | 4,25% | 4,25% | 4,25% | 4,25% | 4,25% |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | | | | | |
| Monto | 40,0 | 15,0 | 32,0 | | |
| 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 | 90,8 | 159,2 | 157,7 | 136,3 | 134,3 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 895,1 | 892,9 | 890,9 | 888,1 | 885,5 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6,7 | 6,7 | 6,6 | 6,6 | 6,6 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 204,3 | 202,1 | 200,1 | 197,3 | 194,7 |
| b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1,5 | 1,5 | 1,5 | 1,5 | 1,5 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 215,7 | 201,5 | 289,0 | 280,7 | 374,9 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 3,65/3,90/3,74 | 3,85/4,10/3,92 | 3,85/4,00/3,90 | 3,80/3,95/3,85 | 3,75/4,00/3,85 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera | 63,5 | 83,0 | 85,5 | 77,5 | 88,5 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | 1,30/2,71/2,30 | 1,30/2,71/2,40 | 1,05/2,71/2,36 | 1,30/2,71/2,48 | 1,30/2,71/2,49 |
| c. Mercado secundario de CDBCRP | | | | 3,0 | |
| Tasas de interés (rendimiento para el comprador): Mínima / Máxima / Promedio | | | | 3,62/3,65/3,64 | |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | | | | | |
| Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f | -4,8 | -13,5 | -4,6 | 13,8 | 12,0 |
| Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f | 10,0 | -5,3 | 6,3 | 24,0 | 11,1 |
| a. Mercado spot con el público (**) | 9,5 | 0,1 | 2,4 | 24,0 | 11,1 |
| i. Compras | 62,9 | 58,2 | 57,1 | 72,5 | 57,4 |
| ii. (-) Ventas | 53,4 | 58,1 | 54,7 | 48,5 | 46,3 |
| b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**) | 0,0 | 3,7 | 1,1 | -11,1 | 5,6 |
| i. Pactadas | 0,0 | 11,2 | 1,1 | 2,6 | 6,6 |
| ii. (-) Vencidas | 0,0 | 7,5 | 0,0 | 13,7 | 1,1 |
| c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**) | 14,8 | 11,8 | 11,9 | -0,9 | 4,7 |
| i. Pactadas | 29,5 | 32,3 | 22,0 | 11,8 | 31,9 |
| ii. (-) Vencidas | 14,6 | 20,4 | 10,1 | 12,7 | 27,3 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias (**) | | | | | |
| i. Al contado | 74,9 | 75,8 | 90,9 | 110,3 | 81,1 |
| ii. A futuro | 17,2 | 13,0 | 18,0 | 14,0 | 23,0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**) | 13,1 | 6,5 | 11,0 | -2,5 | 25,1 |
| i. Compras | 13,1 | 14,0 | 11,0 | 7,5 | 25,1 |
| ii. (-) Ventas | 0,0 | 7,5 | | 10,0 | |
| f. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 2,0 | 1,0 | 3,0 | 1,5 | 1,1 |
| g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | 0,0 | 0,0 | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio | 3,492 | 3,497 | 3,504 | 3,499 | 3,497 |
| * Datos preliminares ** Datos preliminares para el último día | | | | | |