

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

	16 Diciembre	17 Diciembre	18 Diciembre	19 Diciembre	20 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	247,8	265,2	156,2	31,7	-22,5
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)	40,0	50,0	40,0		
Propuestas recibidas	154,0	214,2	160,1		
Plazo de vencimiento	1 año	6 meses	9 meses		
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	4,99 / 5,02 / 5,02	4,05 / 4,10 / 4,09	4,17 / 4,25 / 4,21		
Saldo de CDBCRP	1 600,1	1 660,1	1 660,1	1 660,1	1 660,1
Próximo vencimiento de CDBCRP (24 de diciembre del 2002)					100,0
Vencimientos de CDBCRP del 23 al 27 de diciembre del 2002					130,0
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP				140,0	100,0
Propuestas recibidas				161,5	123,1
Plazo de vencimiento				7 días	3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio				3,39 / 3,73 / 3,54	3,50 / 3,71 / 3,52
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	306,7	307,2	307,4	308,4	308,7
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP					
i. Compras (equivalente en millones de S/.)	17,5				
Monto (millones de US\$)	5,0				
Tipo de cambio promedio	3,4915				
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	225,3	175,2	156,2	171,7	77,5
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)	0,01010%	0,01010%	0,01010%	0,01010%	0,01010%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)	1,0				
Tasa de interés	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%	4,50%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	122,5		29,5	109,0	
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	103,8	175,2	126,7	62,7	77,5
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	879,1	874,9	868,4	859,3	851,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	6,6	6,6	6,5	6,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	247,3	243,1	236,6	227,5	220,0
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,9	1,8	1,8	1,7	1,7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	170,8	175,5	131,6	125,6	132,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,40 / 3,75 / 3,58	3,50 / 3,70 / 3,61	60 / 3,80 / 3,6	3,55 / 3,75 / 3,60	3,60 / 4,00 / 3,71
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	104,5	108,5	92,5	102,0	124,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,80 / 2,35 / 2,29	1,80 / 2,35 / 2,28	00 / 2,35 / 2,3	1,20 / 2,35 / 2,29	2,00 / 2,35 / 2,31
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	31,2	19,8	14,1	18,3	-7,7
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	-16,9	7,7	12,2	17,6	-2,6
a. Mercado spot con el público (**)	-32,0	12,2	6,9	18,4	8,0
i. Compras	57,6	77,6	64,9	74,1	61,8
ii. (-) Ventas	89,6	65,4	58,0	55,7	53,8
b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)	0,2	-0,2	9,0	-7,7	-0,6
i. Pactadas	46,2	0,7	9,3	0,9	1,0
ii. (-) Vencidas	46,1	0,9	0,3	8,6	1,5
c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)	-48,0	-12,3	7,1	-8,5	4,6
i. Pactadas	42,4	30,4	24,5	18,6	39,2
ii. (-) Vencidas	90,4	42,7	17,4	27,0	34,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)					
i. Al contado	94,1	80,7	109,3	84,6	84,5
ii. A futuro	3,0	1,0	5,3	5,6	9,7
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	61,9	32,4	17,9	18,1	34,7
i. Compras	107,9	32,4	17,9	26,1	34,7
ii. (-) Ventas	46,0			8,0	
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2,5	5,0	4,5	-0,5	-12,3
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0
Tasa de interés	2,45%	2,45%	2,45%	2,45%	2,45%
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,493	3,496	3,500	3,513	3,513
* Datos preliminares					
** Datos preliminares para el último día					