

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

	23 Diciembre	24 Diciembre	26 Diciembre	27 Diciembre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-130,6	-83,8	-12,3	88,7
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	1 660,1	1 560,1	1 530,1	1 530,1
Próximo vencimiento de CDBCRP (15 de enero del 2003)				25,0
Vencimientos de CDBCRP del 30 de diciembre de 2002 al 3 de enero de 2003				
ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP	145,0	100,0	245,0	70,0
Propuestas recibidas	145,0	150,0	366,6	202,0
Plazo de vencimiento	1 día	9 días	2 días	7 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,01 / 3,80 / 3,28	3,06 / 3,58 / 3,27	3,16 / 3,55 / 3,25	3,61 / 3,83 / 3,70
iii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustable 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
Saldo reajustado de CDR BCRP	307,7	307,3	308,5	309,5
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 antes del cierre de operaciones	14,4	261,2	207,7	143,7
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)	35,0			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,01000%	0,009300%	0,01000%	0,00900%
b. Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)				
Tasa de interés	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%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional				
Tasa de interés	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	49,4	261,2	162,7	129,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	832,0	834,5	835,2	832,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,3	6,3	6,3	6,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	200,2	202,7	203,4	200,7
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,5	1,5	1,5	1,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	181,1	170,8	138,3	109,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,40 / 4,10 / 3,78	3,70 / 4,25 / 4,04	3,80 / 4,30 / 4,17	3,50 / 3,80 / 3,71
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera	119,0	114,0	123,0	118,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,28 / 2,35 / 2,30	2,10 / 2,43 / 2,40	1,28 / 2,45 / 2,34	1,20 / 2,69 / 2,43
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	6,0	-24,0	13,0	-15,0
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	11,4	-22,8	11,5	-18,0
a. Mercado spot con el público (**)	4,0	-23,1	7,7	-20,2
i. Compras	92,9	30,9	72,8	46,7
ii. (-) Ventas	88,9	54,0	65,1	66,9
b. Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)	0,8	-0,6		2,9
i. Pactadas	11,2			10,1
ii. (-) Vencidas	10,4	0,6		7,2
c. Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)	6,2	0,6	-1,5	-0,2
i. Pactadas	35,5	43,0	33,3	25,6
ii. (-) Vencidas	29,3	42,4	34,8	25,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias (**)				
i. Al contado	102,0	45,4	119,5	102,8
ii. A futuro	13,4	9,0	8,5	5,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)	21,8	42,1	28,1	16,3
i. Compras	31,8	42,1	28,1	22,3
ii. (-) Ventas	10,0			6,0
f. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4,5		10,5	4,5
g. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	100,0	100,0	100,0	
Tasa de interés	2,45%	2,45%	2,45%	
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,503	3,498	3,512	3,523
* Datos preliminares				
** Datos preliminares para el último día				