

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

	27 Enero	28 Enero	29 Enero	30 Enero	31 Enero
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-111,8	95,7	154,1	146,1	109,3
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>			30,0	25,0	
Propuestas recibidas			87,2	77,0	
Plazo de vencimiento			4,38/4,67/4,52	3,97/4,12/4,05	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio			1 año	9 meses	
Saldo de CDBCRP	2 050,1	2 050,1	2 105,1	2 105,1	2 105,1
Próximo vencimiento de CDBCRP (7 de febrero del 2003)					
Vencimientos de CDBCRP del 30 al 31 de enero de 2003					
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>	245,0	25,0	30,0		30,0
Propuestas recibidas	454,1	87,0	97,0		112,0
Plazo de vencimiento	1 día	1 día	1 día		3 días
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,64/3,80/3,72	3,73/3,73/3,73	3,95/3,96/3,96		3,98/4,11/4,04
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	236,0	236,0	236,0	236,0	236,0
Saldo reajustado de CDR BCRP	227,4	227,3	227,4	226,7	226,4
Próximo vencimiento de CDR BCRP (28 de Febrero del 2003)	70,0	70,0	70,0	70,0	70,0
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	133,2	120,7	129,1	146,1	179,3
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)	0,00820%	0,00820%	0,00820%	0,00820%	0,00820%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>					
Tasa de interés	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Tasa de interés	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%	4,25%
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>	58,0	3,0	30,0	13,0	34,0
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	75,2	117,7	99,1	133,1	145,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S./.) (*)	876,6	874,2	871,3	869,7	868,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,6	6,5	6,5	6,5	6,5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S./.)	185,8	183,4	180,5	178,9	177,8
b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,4	1,3	1,3	1,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>	261,2	316,7	217,1	393,2	233,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	3,70/3,85/3,79	3,70/3,80/3,72	3,70/4,00/3,93	3,75/3,90/3,86	3,75/4,10/3,93
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>	98,5	98,5	98,5	62,0	85,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1,30/2,50/2,34	1,30/2,50/2,34	1,30/2,50/2,34	1,30/2,50/2,41	2,50/2,50/2,50
c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>	2,0	23,0	14,0	3,0	1,0
Tasas de interés (rendimiento para el comprador): Mínima / Máxima / Promedio	3,80/3,85/3,83	3,60/4,94/4,34	3,85/4,01/3,99	3,85/3,85/3,85	3,60/3,60/3,60
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f	2,0	-10,1	20,7	-15,6	1,3
Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f	3,0	-17,5	8,1	1,1	-2,1
a. <u>Mercado spot con el público (**)</u>	4,2	-6,9	10,6	-2,1	1,2
i. Compras	56,1	45,1	57,2	55,6	64,5
ii. (-) Ventas	51,9	52,0	46,6	57,8	63,2
b. <u>Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>	-2,5	2,5	2,1	-0,8	-0,7
i. Pactadas	0,0	3,3	2,6	23,5	0,9
ii. (-) Vencidas	2,6	0,9	0,5	24,3	1,6
c. <u>Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>	-1,6	-5,0	-10,5	15,9	-4,1
i. Pactadas	21,7	15,8	49,4	26,1	16,3
ii. (-) Vencidas	23,3	20,7	59,9	10,2	20,5
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>					
i. Al contado	80,1	62,1	98,9	106,4	58,5
ii. A futuro	11,0	1,5	13,7	16,0	17,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)</u>	18,9	19,1	57,2	-11,0	15,6
i. Compras	18,9	19,1	57,2		15,6
ii. (-) Ventas				23,0	
f. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>					
g. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio	3,499	3,497	3,499	3,488	3,484
* Datos preliminares		** Datos preliminares para el último día			