

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

|  | 12 Mayo        | 13 Mayo        | 14 Mayo        | 15 Mayo        | 16 Mayo        |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| <b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>          | <b>492,0</b>   | <b>258,6</b>   | <b>-18,6</b>   | <b>16,0</b>    | <b>41,9</b>    |
| <b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>                      |                |                |                |                |                |
| a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCR</u>  |                |                |                |                |                |
| i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCR (CDBCRP)</u>  | <u>50,0</u>    | <u>115,5</u>   |                |                |                |
| Propuestas recibidas   | 187,5          | 223,6          |                |                |                |
| Plazo de vencimiento   | 6 meses        | 1 semana       |                |                |                |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   | 4,26/4,28/4,28 | 3,73/3,95/3,93 |                |                |                |
| Saldo  | 3 185,6        | 3 185,6        | 3 185,6        | 3 185,6        | 3 155,6        |
| Próximo vencimiento ( 16 de Mayo de 2003 )   |                |                |                |                |                |
| Vencimientos del 14 al 16 de Mayo de 2003  |                |                |                |                |                |
| ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>   |                |                | <u>80,0</u>    | <u>170,0</u>   | <u>145,0</u>   |
| Propuestas recibidas   |                |                | 102,9          | 248,9          | 322,7          |
| Plazo de vencimiento   |                |                | 1 semana       | 1 día          | 1 día          |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   |                |                | 3,73/3,73/3,73 | 3,36/3,78/3,69 | 3,61/3,76/3,67 |
| Saldo  |                |                |                |                | 3,71/3,75/3,73 |
| iii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajutable del BCR (CDRBCRP)</u>                              |                |                |                |                |                |
| Propuestas recibidas   |                |                |                |                |                |
| Plazo de vencimiento   |                |                |                |                |                |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   |                |                |                |                |                |
| Saldo  |                |                |                |                |                |
| Próximo vencimiento  |                |                |                |                |                |
| b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</u>   |                | <u>0,0</u>     |                |                |                |
| i. <u>Compras (millones de US\$)</u>   |                |                |                |                |                |
| Tipo de cambio promedio  |                |                |                |                |                |
| ii. <u>Ventas (millones de US\$)</u>   |                |                |                |                |                |
| Tipo de cambio promedio  |                |                |                |                |                |
| <b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b> | <b>326,5</b>   | <b>258,6</b>   | <b>231,4</b>   | <b>161,0</b>   | <b>151,9</b>   |
| <b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>                                     |                |                |                |                |                |
| a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>                            |                |                |                |                |                |
| Comisión (tasa efectiva diaria)  | 0,00830%       | 0,00830%       | 0,00830%       | 0,00830%       | 0,00830%       |
| 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>   |                |                |                | <u>50,0</u>    | <u>25,0</u>    |
| Tasa de interés  | 3,00%          | 3,00%          | 3,00%          | 3,00%          | 3,00%          |
| <b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>        | <b>326,5</b>   | <b>258,6</b>   | <b>231,4</b>   | <b>111,0</b>   | <b>126,9</b>   |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)                            | 965,8          | 962,7          | 958,1          | 946,1          | 936,9          |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                 | 7,2            | 7,1            | 7,1            | 7,0            | 6,9            |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)                                   | 298,9          | 295,8          | 291,2          | 279,2          | 270,0          |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                    | 2,2            | 2,2            | 2,2            | 2,1            | 2,0            |
| <b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>   |                |                |                |                |                |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>  | <u>158,1</u>   | <u>204,0</u>   | <u>227,8</u>   | <u>238,1</u>   | <u>229,0</u>   |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio  | 3,70/3,80/3,75 | 3,70/3,75/3,74 | 3,70/3,80/3,72 | 3,70/3,75/3,72 | 3,70/3,80/3,74 |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>  |                | <u>5,0</u>     | <u>5,0</u>     | <u>5,0</u>     | <u>3,0</u>     |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio  |                | 1,22/1,22/1,22 | 1,21/1,21/1,21 | 1,31/1,31/1,31 | 1,21/1,21/1,21 |
| c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>   | <u>0,3</u>     | <u>16,0</u>    | <u>6,0</u>     | <u>16,0</u>    | <u>6,5</u>     |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)  |                |                | 1,0 / 4,10     |                |                |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)   |                |                |                |                |                |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)   | 0,3 / 5,95     |                | 5,0 / 5,85     | 4,0 / 5,95     | 2,0 / 5,80     |
| <b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>                    |                |                |                |                |                |
| Flujo de la posición global ** = a + b.i - c.i + e + f   | 2,6            | -14,5          | 25,2           | -3,1           | -8,2           |
| Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f   | -12,5          | 18,7           | 5,3            | 12,6           | 46,7           |
| a. <u> Mercado spot con el público (**) </u>   | <u>-12,3</u>   | <u>20,7</u>    | <u>24,0</u>    | <u>12,8</u>    | <u>16,1</u>    |
| i. <u> Compras </u>  | 59,9           | 64,3           | 63,6           | 55,1           | 60,2           |
| ii. <u> (-) Ventas </u>  | 72,2           | 43,6           | 39,6           | 42,3           | 44,1           |
| b. <u> Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>   | <u>5,3</u>     | <u>-5,0</u>    | <u>5,4</u>     | <u>-2,4</u>    | <u>-4,5</u>    |
| i. <u> Pactadas </u>   | 11,8           | 16,0           | 13,2           | 5,6            | 5,6            |
| ii. <u> (-) Vencidas </u>  | 6,5            | 20,9           | 7,8            | 8,0            | 10,1           |
| c. <u> Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>  | <u>-9,8</u>    | <u>28,3</u>    | <u>-14,5</u>   | <u>13,4</u>    | <u>50,4</u>    |
| i. <u> Pactadas </u>   | 0,2            | 32,5           | 21,1           | 28,2           | 90,0           |
| ii. <u> (-) Vencidas </u>  | 10,0           | 4,2            | 35,7           | 14,8           | 39,6           |
| d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias (**) </u>   |                |                |                |                |                |
| i. <u> Al contado </u>   | 45,5           | 72,3           | 37,2           | 44,7           | 61,6           |
| ii. <u> A futuro </u>  |                | 4,5            | 8,0            | 1,0            | 6,0            |
| e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)</u>                  | <u>1,3</u>     | <u>-18,7</u>   | <u>10,2</u>    | <u>8,4</u>     | <u>70,1</u>    |
| i. <u> Compras </u>  | 8,0            | 2,0            | 17,9           | 14,0           | 78,7           |
| ii. <u> (-) Ventas </u>  | 6,7            | 20,7           | 7,7            | 5,6            | 8,6            |
| f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras </u>  | <u>2,0</u>     | <u>0,0</u>     | <u>-1,0</u>    | <u>-1,8</u>    | <u>-10,0</u>   |
| g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera </u>  |                | <u>0,0</u>     |                |                |                |
| Tasa de interés  |                |                |                |                |                |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio  | 3,474          | 3,476          | 3,475          | 3,475          | 3,475          |
| * Datos preliminares   |                |                |                |                |                |
| ** Datos preliminares para el último día   |                |                |                |                |                |