

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

|  | 26 Mayo        | 27 Mayo        | 28 Mayo        | 29 Mayo        | 30 Mayo        |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| <b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCR</b>          | <b>-27,9</b>   | <b>-9,8</b>    | <b>-0,4</b>    | <b>60,9</b>    | <b>39,8</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>  |                |                |                |                |                |
| Propuestas recibidas   |                |                |                |                |                |
| Plazo de vencimiento   |                |                |                |                |                |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   |                |                |                |                |                |
| Saldo  | 2 975,1        | 2 975,1        | 2 975,1        | 2 975,1        | 2 975,1        |
| Próximo vencimiento ( 9 de Junio de 2003 )   |                |                |                |                | 50,0           |
| Vencimientos del 28 al 30 de Mayo de 2003  |                |                |                |                | 0,0            |
| ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>   | <u>125,0</u>   | <u>120,0</u>   | <u>50,0</u>    | <u>75,0</u>    | <u>80,0</u>    |
| Propuestas recibidas   | 199,0          | 169,0          | 154,0          | 126,0          | 85,0           |
| Plazo de vencimiento   | 1 día          | 1 día          | 7 días         | 1 día          | 7 días         |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   | 3,75/3,79/3,77 | 3,73/3,79/3,77 | 3,85/3,91/3,89 | 3,83/3,96/3,90 | 3,25/3,83/3,72 |
| Saldo  |                |                |                |                | 3,81/3,81/3,81 |
| 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. Compras (millones de US\$)  |                |                |                |                |                |
| Tipo de cambio promedio  |                |                |                |                |                |
| ii. Ventas (millones de US\$)  |                |                |                |                |                |
| 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>97,1</b>    | <b>110,2</b>   | <b>124,6</b>   | <b>140,9</b>   | <b>69,8</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)  | 0,00840%       | 0,00840%       | 0,00840%       | 0,00840%       | 0,00840%       |
| 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>   |                |                |                |                |                |
| 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>97,1</b>    | <b>110,2</b>   | <b>124,6</b>   | <b>137,9</b>   | <b>69,8</b>    |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)                            | 871,2          | 867,7          | 865,0          | 862,9          | 858,7          |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                 | 6,4            | 6,4            | 6,4            | 6,3            | 6,3            |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)                                   | 204,3          | 200,8          | 198,1          | 196,0          | 191,8          |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                    | 1,5            | 1,5            | 1,5            | 1,4            | 1,4            |
| <b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>   |                |                |                |                |                |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>  | <u>134,5</u>   | <u>176,0</u>   | <u>196,1</u>   | <u>225,8</u>   | <u>194,5</u>   |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio  | 3,75/3,75/3,75 | 3,70/3,85/3,80 | 3,85/4,00/3,95 | 3,50/3,90/3,79 | 3,70/3,80/3,73 |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>  |                | <u>5,0</u>     | <u>12,0</u>    | <u>13,0</u>    | <u>7,5</u>     |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio  |                | 1,27/1,27/1,27 | 1,10/1,30/1,25 | 1,10/1,30/1,24 | 1,10/1,40/1,26 |
| c. <u>Total mercado secundario de CDBCRP</u>   |                | <u>6,0</u>     |                | <u>14,5</u>    | <u>22,0</u>    |
| Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)  |                |                |                | 2,0 / 4,22     | 12,0 / 4,16    |
| Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)   |                |                |                |                |                |
| Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)   |                |                |                |                |                |
| <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   | 4,4            | -4,0           | -20,4          | 1,2            | 27,7           |
| Flujo de la posición contable ** = a + b.ii - c.ii + e + f   | 8,8            | 3,1            | 17,3           | 7,0            | 32,1           |
| a. <u> Mercado spot con el público (**)</u>  | <u>13,6</u>    | <u>6,4</u>     | <u>12,9</u>    | <u>8,2</u>     | <u>17,8</u>    |
| i. Compras   | 68,1           | 50,5           | 58,1           | 57,0           | 81,1           |
| ii. (-) Ventas   | 54,5           | 44,1           | 45,2           | 48,8           | 63,3           |
| b. <u> Compras forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>   | <u>-1,4</u>    | <u>-3,4</u>    | <u>-7,5</u>    | <u>-3,3</u>    | <u>1,4</u>     |
| i. Pactadas  | 1,2            | 7,0            | 6,1            | 9,2            | 7,1            |
| ii. (-) Vencidas   | 2,6            | 10,4           | 13,6           | 12,5           | 5,7            |
| c. <u> Ventas forward con el público (con y sin entrega) (**)</u>  | <u>3,0</u>     | <u>3,7</u>     | <u>30,2</u>    | <u>2,5</u>     | <u>5,8</u>     |
| i. Pactadas  | 42,9           | 18,3           | 78,0           | 15,1           | 71,6           |
| ii. (-) Vencidas   | 39,9           | 14,6           | 47,8           | 12,6           | 65,7           |
| d. <u> Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>  |                |                |                |                |                |
| i. Al contado  | 81,8           | 57,7           | 85,6           | 35,7           | 56,2           |
| ii. A futuro   | 4,0            | 10,5           | 6,0            | 10,7           | 1,0            |
| e. <u> Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega (**)</u>                  | <u>32,0</u>    | <u>-0,6</u>    | <u>42,9</u>    | <u>2,4</u>     | <u>78,4</u>    |
| i. Compras   | 32,0           | 6,0            | 56,0           | 14,0           | 84,0           |
| ii. (-) Ventas   |                | 6,6            | 13,1           | 11,6           | 5,6            |
| f. <u> Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>   | <u>0,5</u>     | <u>1,5</u>     | <u>-4,3</u>    | <u>-3,5</u>    | <u>-4,0</u>    |
| g. <u> Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>   |                |                |                |                | <u>0,0</u>     |
| Tasa de interés  |                |                |                |                |                |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio  | 3,489          | 3,491          | 3,500          | 3,494          | 3,496          |
| * Datos preliminares   |                |                |                |                |                |
| ** Datos preliminares para el último día   |                |                |                |                |                |