

Operaciones Monetarias y Cambiarias 1999

Setiembre 1999					
CERTIFICADO DE DEPOSITOS DEL BCRP (Millones de S/.)	Lunes 27	Martes 28	Miércoles 29	Jueves 30	Viernes 01
Saldo de CDBCRP	1425,6	1364,7	1434,7	1434,7	1434,7
Próximo vencimiento de CDBCRP (04 de octubre de 1999)					120
Vencimientos de CDBCRP del 01 al 15 de octubre de 1999					219,1
Resultado de la subasta de fondos del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Propuestas aceptadas					
Tasas de interés aceptadas					
Minima					
Maxima					
Promedio					
Resultado de la subasta CDBRP					
Propuestas recibidas		99,1	150,2		
Propuestas aceptadas		99,1	70,0		
Plazo vencimiento CD BCRP		1 semana	6 semanas		
Tasas de interés aceptadas					
Minima		13,78%	14,90%		
Maxima		21,00%	18,59%		
Promedio		17,76%	17,40%		
Resultado de la subasta de compra temporal de CDBCRP (Repo)					
Propuestas recibidas					
Propuestas aceptadas					
Tasas de interés aceptadas					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Mercado secundario de CDBCRP					
Monto negociado			67,8	19,9	1,3
Tasas de interés (Rendimiento para el comprador)					
Minima			10,06%	10,05%	11,22%
Maxima			13,75%	18,02%	11,22%
Promedio			12,78%	13,25%	11,22%
CREDITO CON GARANTIA DE TITULOS VALORES					
Monto negociado (millones de S/.)					
Tasa de Interés					
CREDITO CON GARANTIA DE TITULOS VALORES					
Monto negociado (millones de US\$)					
Tasa de Interés					
COMPRA TEMPORAL DE MONEDA EXTRANJERA (SWAP)					
Monto negociado (millones de US\$)			6,3		7,8
Comisión (tasa efectiva diaria)			0,02410%	0,02410%	0,02410%

COMPRAS DE MONEDA EXTRANJERA EN LA MESA DE NEGOCIACION					
Monto (millones de US\$)		-16,0	-5,0		
Tipo de cambio promedio (nuevos soles por US\$)		3,4633	3,4594		
OTROS INDICADORES					
Cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP (Saldo millones de S/.)	77,4	116,0	77,2	60,6	64,0
Operaciones interbancarias a la vista en moneda nacional					
Monto (Millones de S/.)	281,9	209,5	170,76	297,8	198,3
Tasas de interés					
Mínima	18,00%	13,80%	14,00%	18,50%	20,00%
Máxima	23,50%	20,25%	19,25%	25,00%	27,00%
Promedio	20,85%	15,86%	16,63%	22,54%	24,34%
Operaciones interbancarias a la vista en moneda extranjera					
Monto (Millones de US\$)	44,0	73,0	56,5	39	45
Tasas de interés					
Mínima	5,50%	5,50%	5,50%	7,50%	6,80%
Máxima	9,50%	9,50%	9,50%	9,50%	9,50%
Promedio	7,61%	6,98%	7,86%	8,29%	8,12%
Operaciones del mercado cambiario de las empresas bancarias (Millones de US\$)					
Compras al contado con el público	21,0	27,0	24,5	33,7	36,1
Ventas al contado con el público	33,6	22,4	26,0	41,2	26,1
Compras al contado interbancarias	87,6	86,0	80,5	72,4	55,9
Compras a futuro pactadas con el público	0,7	6,0	11,5	14,4	5,2
Ventas a futuro pactadas con el público	9,8	0,4	1,4	2,1	5,3
Compras a futuro pactadas interbancarias	4,0	3,0	3,0	5,0	8,0