

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

|   | 24 Setiembre | 25 Setiembre  | 26 Setiembre  | 27 Setiembre | 28 Setiembre |
|---|--------------|---------------|---------------|--------------|--------------|
| <b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>          | <b>99,9</b>  | <b>-101,6</b> | <b>-131,3</b> | <b>-4,1</b>  | <b>-3,3</b>  |
| <b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones</b>                      |              |               |               |              |              |
| a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCRP</u>  |              |               |               |              |              |
| i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP)</u>  |              |               |               |              |              |
| Propuestas recibidas  | --           | --            | --            | --           | --           |
| Propuestas aceptadas  | --           | --            | --            | --           | --           |
| Plazo de vencimiento  | --           | --            | --            | --           | --           |
| Tasas de interés  |              |               |               |              |              |
| Mínima  | --           | --            | --            | --           | --           |
| Máxima  | --           | --            | --            | --           | --           |
| Promedio  | --           | --            | --            | --           | --           |
| Saldo de CDBCRP   | 2 050,0      | 2 050,0       | 2 050,0       | 1 990,0      | 1 990,0      |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (12 de octubre del 2 001)   |              |               |               | --           | 20,0         |
| Vencimientos de CDBCRP del 1 al 5 de octubre del 2 001  |              |               |               | --           | --           |
| ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>  |              |               |               |              |              |
| Propuestas recibidas  | --           | 312,6         | 235,0         | 220,5        | 172,0        |
| Propuestas aceptadas  | --           | 215,0         | 220,0         | 140,0        | 85,0         |
| Tasas de interés  |              |               |               |              |              |
| Mínima  | --           | 6,01%         | 5,58%         | 5,76%        | 6,50%        |
| Máxima  | --           | 6,78%         | 7,01%         | 6,08%        | 6,95%        |
| Promedio  | --           | 6,41%         | 6,35%         | 6,04%        | 6,62%        |
| 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   | --           | --            | --            | --           | --           |
| <b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP antes del cierre de operaciones</b> |              |               |               |              |              |
| a. Antes de operaciones de compra temporal de CDBCRP y de BTP   | 99,9         | -101,6        | -131,3        | -4,1         | -3,3         |
| b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP   | 99,9         | 113,4         | 88,7          | 135,9        | 81,7         |
| <b>4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones</b>                                     |              |               |               |              |              |
| a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>                             | --           | --            | --            | --           | 2,4          |
| Monto (millones de US\$)  | --           | --            | --            | --           | 0,7          |
| Comisión (tasa efectiva diaria)   | 0,01340%     | 0,01340%      | 0,01340%      | 0,01340%     | 0,01340%     |
| b. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>   |              |               |               |              |              |
| Monto   | --           | --            | --            | --           | --           |
| Tasa de interés   | --           | --            | --            | --           | --           |
| c. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>  |              |               |               |              |              |
| Monto   | --           | --            | --            | 38,0         | 25,0         |
| Tasa de interés   | 4,00%        | 4,00%         | 4,00%         | 4,00%        | 4,00%        |
| <b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones</b>        | <b>99,9</b>  | <b>113,4</b>  | <b>88,7</b>   | <b>97,9</b>  | <b>59,1</b>  |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)                             | 758,0        | 757,1         | 756,2         | 755,5        | 753,5        |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                  | 6,4          | 6,4           | 6,4           | 6,4          | 6,4          |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)                                    | 150,6        | 149,1         | 146,8         | 145,0        | 136,4 **     |
| b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                     | 1,3          | 1,3           | 1,2           | 1,2          | 1,2          |
| <b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>  |              |               |               |              |              |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>   |              |               |               |              |              |
| i. Monto  | 108,7        | 136,8         | 36,9          | 82,2         | 93,2         |
| ii. Tasas de interés  |              |               |               |              |              |
| Mínima  | 4,75%        | 5,50%         | 6,25%         | 6,00%        | 6,00%        |
| Máxima  | 7,00%        | 7,00%         | 7,00%         | 7,00%        | 8,00%        |
| Promedio  | 5,60%        | 6,53%         | 6,48%         | 6,19%        | 6,88%        |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>   |              |               |               |              |              |
| i. Monto  | 3,0          | 3,0           | 3,0           | 2,7          | 2,0          |
| ii. Tasas de interés  |              |               |               |              |              |
| Mínima  | 4,50%        | 4,50%         | 3,17%         | 3,20%        | 4,25%        |
| Máxima  | 4,50%        | 4,50%         | 3,17%         | 4,50%        | 4,50%        |
| Promedio  | 4,50%        | 4,50%         | 3,17%         | 4,16%        | 4,38%        |
| c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>  |              |               |               |              |              |
| i. Monto  | --           | 6,2           | 4,4           | 2,0          | 9,5          |
| ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador)  |              |               |               |              |              |
| Mínima  | --           | 7,00%         | 6,70%         | 7,75%        | 6,50%        |
| Máxima  | --           | 8,50%         | 8,50%         | 7,75%        | 7,85%        |
| Promedio  | --           | 8,33%         | 7,69%         | 7,75%        | 7,14%        |
| <b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>                     |              |               |               |              |              |
| a. <u>Flujo de la posición de cambios</u> (***)   |              |               |               |              |              |
| i. Compras al contado al público  | 62,1         | 69,7          | 75,8          | 66,3         | 70,1         |
| ii. Ventas al contado al público  | 66,3         | 81,9          | 69,5          | 67,5         | 55,3         |
| iii. Compras a futuro pactadas con el público   | 4,1          | 5,6           | 1,1           | 5,8          | 1,3          |
| iv. Ventas a futuro pactadas con el público   | 20,5         | 6,1           | 6,4           | 4,6          | 0,3          |
| v. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público  | 0,3          | 6,7           | 4,0           | 2,4          | 3,8          |
| vi. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público  | 13,4         | 1,3           | 15,9          | 0,5          | 6,9          |
| b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u> (***)   |              |               |               |              |              |
| i. Al contado   | 41,1         | 44,9          | 69,0          | 38,8         | 51,0         |
| ii. A futuro  | --           | 6,5           | 23,5          | 2,0          | 10,5         |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>   |              |               |               |              |              |
| i. Monto  | --           | --            | --            | --           | --           |
| ii. Tasa de interés   | --           | --            | --            | --           | --           |

\* Datos preliminares

\*\* Promedio acumulado de setiembre.

\*\*\* Datos preliminares para el último día.