

Operaciones Monetarias y Cambiarias

(Agosto 1999)

CERTIFICADO DE DEPOSITOS DEL BCRP (Millones de S/.)	Lunes 23	Martes 24	Miércoles 25	Jueves 26	Viernes 27
Saldo de CDBCRP	1410,5	1410,5	1380,5	1380,5	1415,5
Próximo vencimiento de CDBCRP (01 de setiembre de 1999)	30,0	30,0	100,0		50,0
Vencimientos de CDBCRP del 27 al 31 de agosto de 1999	130,0	130,0	100,0		
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 primaria CDBRP					
Propuestas recibidas				210,1	76,0
Propuestas aceptadas				100,0	35,0
Plazo de vencimientos de los CDBCRP				16 semanas	16 semanas
Tasas de interés aceptadas					
Minima				9,50%	10,24%
Maxima				11,24%	11,08%
Promedio				10,49%	10,82%
Resultado de la subasta de compra temporal de CDBCRP (Repo)					
Propuestas recibidas	174,0	138,0	45,0		
Propuestas aceptadas	90,0	100,0	20,0		
Tasas de interés aceptadas					
Mínima	12,05%	11,85%	8,99%		
Máxima	12,98%	13,10%	10,01%		
Promedio	12,40%	12,56%	9,75%		
Mercado secundario de CDBCRP					
Monto negociado	9,0		1,5		5,3
Tasas de interés (Rendimiento para el comprador)					
Minima	8,30%		8,90%		10,05%
Maxima	9,80%		8,90%		10,23%
Promedio	9,42%		8,90%		10,19%
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\$)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0241%	0,0241%	0,0241%	0,0241%	0,0241%
COMPRAS DE MONEDA EXTRANJERA EN LA MESA DE NEGOCIACION					
Monto (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio (nuevos soles por US\$)					
OTROS INDICADORES					
Cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP (Saldo millones de S/.)	134,9	140,5	152,3	185,0	133,1
Operaciones interbancarias a la vista en moneda nacional					
Monto (Millones de S/.)	184,1	95,9	107,9	133,6	162,1
Tasas de interés					
Mínima	11,00%	10,00%	8,50%	4,00%	3,00%
Máxima	17,50%	15,00%	14,00%	8,00%	5,00%
Promedio	12,94%	12,43%	10,04%	5,40%	4,14%
Operaciones interbancarias a la vista en moneda extranjera					
Monto (Millones de US\$)	131,0	151,2	151,5	113,5	102,5
Tasas de interés					
Mínima	5,75%	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
Máxima	9,50%	9,50%	9,50%	9,50%	9,50%
Promedio	6,48%	6,28%	6,17%	6,41%	6,58%
Operaciones del mercado cambiario de las empresas bancarias (Millones de US\$)					
Compras netas spot	-37,2	9,8	48,3	7,0	7,4
Operaciones netas a futuro pactadas	-0,6	-2,7	-6,4	3,5	0,0
Total transado spot	159,4	133,4	197,0	139,0	182,8
Total Transado de operaciones a futuro pactadas	4,7	3,7	12,0	15,0	24,3