

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

| | 19 Mar. | 20 Mar. | 21 Mar. | 22 Mar. | 23 Mar. |
|---|-------------|--------------|--------------|-------------|-------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 78.4 | 137.3 | 167.0 | 50.2 | 17.4 |
| 2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones | | | | | |
| a. <u>Operaciones monetarias anunciadas del BCRP</u> | | | | | |
| i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP)</u> | | | | | |
| Propuestas recibidas | 0.0 | 0.0 | 273.3 | 0.0 | 0.0 |
| Propuestas aceptadas | 0.0 | 0.0 | 70.0 | 0.0 | 0.0 |
| Plazo de vencimiento | - | - | 16 semanas | - | - |
| Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | - | - | 10.91% | - | - |
| Máxima | - | - | 10.97% | - | - |
| Promedio | - | - | 10.94% | - | - |
| Saldo de CDBCRP | 2,080.3 | 2,080.3 | 1,995.3 | 1,995.3 | 1,995.3 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (2 de abril del 2 001) | | | | | 100.0 |
| Vencimientos de CDBCRP del 26 al 30 de marzo del 2 001 | | | | | 0.0 |
| ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP</u> | | | | | |
| Propuestas recibidas | 103.9 | 0.0 | 0.0 | 63.9 | 75.0 |
| Propuestas aceptadas | 35.0 | 0.0 | 0.0 | 30.0 | 75.0 |
| Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 10.06% | - | - | 9.54% | 8.77% |
| Máxima | 10.36% | - | - | 9.81% | 9.58% |
| Promedio | 10.18% | - | - | 9.67% | 9.07% |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP antes del cierre de operaciones | | | | | |
| a. Antes de operaciones de compra temporal de CDBCRP | 78.4 | 137.3 | 97.0 | 50.2 | 17.4 |
| b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP | 113.4 | 137.3 | 97.0 | 80.2 | 92.4 |
| 4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u> | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Monto (millones de US\$) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0.01650% | 0.01650% | 0.01650% | 0.01650% | 0.01650% |
| b. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u> | | | | | |
| Monto | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Tasa de interés | - | - | - | - | - |
| c. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u> | | | | | |
| Monto | 45.0 | 38.0 | 19.5 | 0.0 | 0.0 |
| Tasa de interés | 4.00% | 4.00% | 4.00% | 4.00% | 4.00% |
| 5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones | 68.4 | 99.3 | 77.5 | 80.2 | 92.4 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*) | 758.3 | 755.3 | 751.8 | 748.4 | 745.8 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 6.8 | 6.8 | 6.8 | 6.7 | 6.7 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) | 161.8 | 158.6 | 154.8 | 151.4 | 148.8 |
| b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1.5 | 1.4 | 1.4 | 1.4 | 1.3 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u> | | | | | |
| i. Monto | 195.7 | 268.4 | 251.6 | 162.5 | 128.2 |
| ii. Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 9.50% | 9.25% | 9.00% | 9.25% | 9.52% |
| Máxima | 10.75% | 10.50% | 10.50% | 10.25% | 10.50% |
| Promedio | 9.88% | 9.72% | 9.51% | 9.69% | 9.88% |
| b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u> | | | | | |
| i. Monto | 23.2 | 31.2 | 59.0 | 21.5 | 33.0 |
| ii. Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 5.70% | 5.00% | 5.25% | 5.25% | 7.75% |
| Máxima | 9.25% | 9.25% | 9.25% | 9.00% | 9.00% |
| Promedio | 8.80% | 7.89% | 9.04% | 8.74% | 8.60% |
| c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u> | | | | | |
| i. Monto | 3.5 | 7.5 | 17.0 | 55.0 | 17.0 |
| ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador) | | | | | |
| Mínima | 10.50% | 11.10% | 9.75% | 10.00% | 10.85% |
| Máxima | 12.00% | 11.80% | 11.85% | 10.75% | 11.65% |
| Promedio | 11.36% | 11.41% | 10.97% | 10.48% | 11.10% |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | | | | | |
| a. <u>Flujo de la posición de cambios (**)</u> | | | | | |
| i. Compras al contado al público | 80.0 | 91.2 | 81.2 | 90.4 | 88.0 |
| ii. Ventas al contado al público | 71.8 | 92.2 | 52.5 | 93.1 | 78.6 |
| iii. Compras a futuro pactadas con el público | 5.6 | 31.0 | 4.8 | 8.0 | 27.0 |
| iv. Ventas a futuro pactadas con el público | 21.3 | 57.3 | 19.8 | 19.1 | 15.6 |
| v. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público | 5.6 | 26.6 | 5.5 | 5.3 | 7.0 |
| vi. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público | 23.0 | 20.4 | 13.0 | 11.7 | 9.7 |
| b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u> | | | | | |
| i. Al contado | 51.6 | 62.6 | 30.1 | 51.0 | 43.7 |
| ii. A futuro | 0.5 | 4.1 | 1.8 | 3.0 | 0.3 |
| c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u> | | | | | |
| i. Monto | 15.0 | 15.0 | 15.0 | 0.0 | 15.0 |
| ii. Tasa de interés | 8.50% | 8.50% | 8.50% | 8.50% | 8.50% |
| * Datos preliminares | | | | | |
| ** Datos preliminares para el último día | | | | | |