

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

| | 4 Junio | 5 Junio | 06 Junio | 07 Junio | 8 Junio |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP | 92,1 | 241,5 | 268,9 | 277,0 | 232,5 |
| 2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones | | | | | |
| a. Operaciones monetarias anunciadas del BCRP | | | | | |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CDBCRP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | -,- | 126,0 | 196,8 | 264,9 | 165,2 |
| Propuestas aceptadas | -,- | 20,0 | 65,0 | 65,0 | 25,0 |
| Plazo de vencimiento | -,- | 20 semanas | 20 semanas | 6 meses | 1 año |
| Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | -,- | 12,24% | 12,25% | 12,12% | 12,15% |
| Máxima | -,- | 12,39% | 12,39% | 12,35% | 12,27% |
| Promedio | -,- | 12,32% | 12,33% | 12,27% | 12,21% |
| Saldo de CDBCRP | 1.605,3 | 1.625,3 | 1.690,3 | 1.755,3 | 1.780,3 |
| Próximo vencimiento de CDBCRP (12 de junio del 2 001) | | 60,0 | 60,0 | 60,0 | 60,0 |
| Vencimientos de CDBCRP del 11 al 15 de junio del 2 001 | | 0,0 | -,- | -,- | 60,0 |
| ii. Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP | | | | | |
| Propuestas recibidas | 147,5 | -,- | -,- | -,- | -,- |
| Propuestas aceptadas | 60,0 | -,- | -,- | -,- | -,- |
| Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 11,50% | -,- | -,- | -,- | -,- |
| Máxima | 13,01% | -,- | -,- | -,- | -,- |
| Promedio | 12,10% | -,- | -,- | -,- | -,- |
| b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP | | | | | |
| i. Compras (equivalente en millones de S./) | | | | | |
| Monto (millones de US\$) | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| Tipo de cambio promedio | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| ii. Ventas (equivalente en millones de S./) | | | | | |
| 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 y de BTP | 92,1 | 221,5 | 203,9 | 212,0 | 207,5 |
| b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP | 152,1 | 221,5 | 203,9 | 212,0 | 207,5 |
| 4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones | | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S./) | | | | | |
| Monto (millones de US\$) | -,- | -,- | -,- | 0,00% | 35,2 |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0,01740% | 0,01740% | 0,01740% | 0,01740% | 0,01740% |
| b. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Monto | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| Tasa de interés | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| c. Depósitos Overnight en moneda nacional | | | | | |
| Monto | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| 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 | 152,1 | 221,5 | 203,9 | 212,0 | 242,7 |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S./) (*) | 650,2 | 685,0 | 708,5 | 723,0 | 737,8 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 5,8 | 6,1 | 6,3 | 6,4 | 6,6 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S./) | 74,3 | 103,7 | 120,4 | 133,4 | 147,0 |
| b. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 0,7 | 0,9 | 1,1 | 1,2 | 1,3 |
| 6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | | | | | |
| i. Monto | 212,1 | 211,6 | 122,3 | 192,5 | 174,0 |
| ii. Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 12,00% | 11,75% | 11,50% | 11,35% | 11,25% |
| Máxima | 14,00% | 13,00% | 12,00% | 12,00% | 11,75% |
| Promedio | 12,88% | 12,01% | 11,89% | 11,61% | 11,50% |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera | | | | | |
| i. Monto | 75,0 | 69,0 | 63,0 | 60,0 | 65,0 |
| ii. Tasas de interés | | | | | |
| Mínima | 4,65% | 4,50% | 5,00% | 5,00% | 5,00% |
| Máxima | 5,75% | 5,25% | 5,25% | 5,25% | 5,25% |
| Promedio | 5,12% | 5,16% | 5,20% | 5,21% | 5,19% |
| c. Mercado secundario de CDBCRP | | | | | |
| i. Monto | 5,0 | 15,0 | -,- | -,- | 5,0 |
| ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador) | | | | | |
| Mínima | 12,75% | 12,50% | -,- | -,- | 11,25% |
| Máxima | 12,75% | 12,75% | -,- | -,- | 12,50% |
| Promedio | 12,75% | 12,58% | -,- | -,- | 11,52% |
| 7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$) | | | | | |
| a. Flujo de la posición de cambios (**) | | | | | |
| i. Compras al contado al público | 75,1 | 88,9 | 57,3 | 83,5 | 50,2 |
| ii. Ventas al contado al público | 115,6 | 96,1 | 62,5 | 87,5 | 53,5 |
| iii. Compras a futuro pactadas con el público | 34,0 | 4,4 | 3,3 | 17,8 | 18,1 |
| iv. Ventas a futuro pactadas con el público | 0,3 | 7,2 | 9,8 | 9,9 | 6,3 |
| v. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público | 28,3 | 18,2 | 2,1 | 25,6 | 0,4 |
| vi. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público | 26,6 | 28,5 | 13,8 | 29,3 | 6,3 |
| b. Operaciones cambiarias interbancarias (**) | | | | | |
| i. Al contado | 51,3 | 49,7 | 57,1 | 88,3 | 81,5 |
| ii. A futuro | -,- | 0,0 | 1,0 | 8,0 | 1,7 |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| i. Monto | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| ii. Tasa de interés | -,- | -,- | -,- | -,- | -,- |
| * Datos preliminares | | | | | |
| ** Datos preliminares para el último día | | | | | |