

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

	1 Octubre	2 Octubre	3 Octubre	04 Octubre	05 Octubre
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-43.7	16.7	34.5	113.9	80.2
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	--	--	--	0.00%	0.00%
Propuestas aceptadas	--	--	--	0.00%	0.00%
Plazo de vencimiento	--	--	--	--	--
Tasas de interés					
Mínima	--	--	--	--	--
Máxima	--	--	--	--	--
Promedio	--	--	--	--	--
Saldo de CDBCRP	1,990.0	1,990.0	1,990.0	1,990.0	1,990.0
Próximo vencimiento de CDBCRP (12 de octubre del 2 001)					20.0
Vencimientos de CDBCRP del 9 al 12 de octubre del 2 001					20.0
ii. <u>Subasta de compra temporal de CDBCRP y de BTP</u>					
Propuestas recibidas	264.2	292.2	266.6	294.6	233.1
Propuestas aceptadas	210.0	170.0	135.0	95.0	120.0
Tasas de interés					
Mínima	5.00%	5.06%	5.11%	5.46%	5.38%
Máxima	6.75%	6.18%	6.50%	6.06%	6.02%
Promedio	6.00%	5.81%	5.68%	5.64%	5.56%
b. <u>Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP</u>					
i. <u>Compras (equivalente en millones de S/.)</u>	--	--	--	0.00%	0.00%
Monto (millones de US\$)	--	--	--	--	--
Tipo de cambio promedio	--	--	--	--	--
ii. <u>Ventas (equivalente en millones de S/.)</u>	--	--	--	0.00%	0.00%
Monto (millones de US\$)	--	--	--	0.00%	0.00%
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	-43.7	16.7	34.5	113.9	80.2
b. Con operaciones de compra temporal de CDBCRP	166.3	186.7	169.5	208.9	200.2
4. Operaciones monetarias del BCRP para el cierre de operaciones					
a. <u>Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Monto (millones de S/.)</u>	--	--	--	0.00%	0.00%
Monto (millones de US\$)	--	--	--	0.00%	0.00%
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.01340%	0.01340%	0.01340%	0.01340%	0.01350%
b. <u>Compra temporal de CDBCRP y BTP (fuera de subasta)</u>					
Monto				0.0	3.0
Tasa de interés				--	0.1
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda nacional</u>					
Monto	--	--	--	0.00%	0.00%
Tasa de interés	--	--	--	--	--
d. <u>Depósitos Overnight en moneda nacional</u>					
Monto	--	--	--	0.00%	0.00%
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	3.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCRP al cierre de operaciones	166.3	186.7	169.5	208.9	203.2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	729.9	766.6	771.0	784.0	790.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.3	6.6	6.6	6.7	6.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	166.1	176.3	174.0	182.7	186.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.4	1.5	1.5	1.6	1.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. <u>Operaciones a la vista en moneda nacional</u>					
i. Monto	80.3	70.1	48.0	105.0	93.5
ii. Tasas de interés					
Mínima	6.00%	5.78%	5.78%	5.80%	5.75%
Máxima	6.75%	6.75%	6.75%	6.75%	6.50%
Promedio	6.32%	6.16%	5.98%	6.12%	5.84%
b. <u>Operaciones a la vista en moneda extranjera</u>					
i. Monto	4.0	5.0	5.0	5.0	2.0
ii. Tasas de interés					
Mínima	4.50%	4.50%	4.50%	4.50%	5.00%
Máxima	5.00%	5.00%	5.00%	5.00%	5.00%
Promedio	4.63%	4.70%	4.70%	4.70%	5.00%
c. <u>Mercado secundario de CDBCRP</u>					
i. Monto	--	4.0	4.3	1.0	2.0
ii. Tasas de interés (rendimiento para el comprador)					
Mínima	--	7.00%	6.90%	8.25%	7.25%
Máxima	--	8.58%	7.25%	8.25%	7.25%
Promedio	--	8.18%	7.17%	8.25%	7.25%
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	88.8	64.9	64.4	64.3	69.6
ii. Ventas al contado al público	70.9	72.3	62.0	82.2	85.1
iii. Compras a futuro pactadas con el público	3.0	8.2	0.0	25.1	29.0
iv. Ventas a futuro pactadas con el público	0.8	8.2	6.9	7.0	28.0
v. Vencimiento de compras a futuro pactadas con el público	12.4	22.2	9.2	17.3	36.7
vi. Vencimiento de ventas a futuro pactadas con el público	22.0	10.5	10.8	13.3	26.7
b. <u>Operaciones cambiarias interbancarias (**)</u>					
i. Al contado	41.3	53.0	59.3	56.5	40.7
ii. A futuro	--	1.0	2.0	8.3	0.3
c. <u>Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera</u>					
i. Monto	--	--	--	0.0	0.0
ii. Tasa de interés	--	--	--	--	--
* Datos preliminares					
** Datos preliminares para el último día					