

Operaciones Monetarias y Cambiarias 1999

Setiembre 1999				
CERTIFICADO DE DEPOSITOS DEL BCRP (Millones de S/.)	Martes 31	Miercoles 01	Jueves 02	Vienes 03
Saldo de CDBCRP	1450.6	1480.6	1520.6	1560.6
Próximo vencimiento de CDBCRP (07 de setiembre de 1999)				120.0
Vencimientos de CDBCRP del 06 al 28 de setiembre de 1999				575.0
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 CDBRP				
Propuestas recibidas	104.5	163.4	112.2	82.0
Propuestas aceptadas	35.0	80.0	40.0	40.0
Plazo vencimiento CD BCRP	16 semanas	16 semanas	16 semanas	16 semanas
Tasas de interés aceptadas				
Minima	10.20%	10.50%	10.49%	10.89%
Maxima	10.89%	10.75%	11.08%	11.24%
Promedio	10.72%	10.65%	10.70%	11.11%
Resultado de la subasta de compra temporal de CDBCRP (Repo)				
Propuestas recibidas				
Propuestas aceptadas				
Tasas de interés aceptadas				
Minima				
Máxima				
Promedio				
Mercado secundario de CDBCRP				
Monto negociado	4.5	20.0	8.3	18.0
Tasas de interés (Rendimiento para el comprador)				
Minima	8.90%	9.10%	10.00%	9.26%
Maxima	10.24%	9.47%	11.22%	10.00%
Promedio	9.79%	9.23%	10.58%	9.60%
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\$)	0.2			7.4
Comisión (tasa efectiva diaria)	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	110.7	87.3	146.3
Operaciones interbancarias a la vista en moneda nacional				
Monto (Millones de S/.)	266.4	206.3	192.2	135.4
Tasas de interés				
Minima	3.00%	4.00%	7.50%	11.00%
Máxima	5.00%	12.00%	14.00%	16.00%
Promedio	3.74%	6.66%	11.38%	13.79%
Operaciones interbancarias a la vista en moneda extranjera				
Monto (Millones de US\$)	99.7	63.5	118.5	163.9
Tasas de interés				
Minima	5.50%	5.75%	6.00%	6.00%
Máxima	9.50%	7.50%	9.50%	9.50%
Promedio	6.61%	6.41%	6.60%	6.84%
Operaciones del mercado cambiario de las empresas bancarias (Millones de US\$)				
Compras netas spot	-5.0	-17.4	-6.6	7.5
Operaciones netas a futuro pactadas	-21.3	-1.7	-5.3	-1.0
Total transado spot	207.8	152.2	185.1	133.0
Total Transado de operaciones a futuro pactadas	35.7	3.7	8.1	10.8