

Operaciones Monetarias y Cambiarias 1999

Setiembre 1999					
CERTIFICADO DE DEPOSITOS DEL BCRP (Millones de S/.)	Lunes 06	Martes 07	Miercoles 08	Jueves 09	Viernes 10
Saldo de CDBCRP	1580.6	1580.6	1630.6	1660.6	1660.6
Próximo vencimiento de CDBCRP (14 de setiembre de 1999)					140.0
Vencimientos de CDBCRP del 13 al 30 de setiembre de 1999					435.0
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	34.0	168.2	72.8	68.4	
Propuestas aceptadas	20.0	120.0	50.0	50.0	
Plazo vencimiento CD BCRP	16 semanas	12 semanas	16 semanas	12 semanas	
Tasas de interés aceptadas					
Minima	10.70%	10.73%	11.16%	11.50%	
Maxima	11.19%	11.74%	12.33%	13.00%	
Promedio	11.08%	11.19%	11.75%	12.28%	
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	10.0			5.3	9.0
Tasas de interés (Rendimiento para el comprador)					
Minima	9.10%			10.81%	10.75%
Maxima	9.10%			11.22%	11.75%
Promedio	9.10%			10.91%	11.08%
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/.)	174.4	242.9	210.1	271.7	160.0
Operaciones interbancarias a la vista en moneda nacional					
Monto (Millones de S/.)	148.8	226.0	163.1	121.0	89.3
Tasas de interés					
Minima	8.00%	7.50%	8.00%	9.00%	12.00%
Máxima	16.50%	11.50%	13.00%	16.00%	16.00%
Promedio	12.09%	9.89%	10.70%	11.82%	14.41%
Operaciones interbancarias a la vista en moneda extranjera					
Monto (Millones de US\$)	137.5	159.0	183.5	135.0	129.5
Tasas de interés					
Minima	6.00%	6.00%	6.00%	5.90%	5.75%
Máxima	9.50%	9.50%	9.50%	9.50%	9.50%
Promedio	6.52%	6.47%	6.56%	6.72%	6.69%
Operaciones del mercado cambiario de las empresas bancarias (Millones de US\$)					
Compras netas spot	-12.4	-1.6	-5.0	-1.3	10.6
Operaciones netas a futuro pactadas	-1.7	8.5	8.6	-6.8	0.7
Total transado spot	93.0	145.4	123.7	122.1	169.6
Total Transado de operaciones a futuro pactadas	3.7	20.1	21.4	11.0	24.9