

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Set 19	24 Set 19	25 Set 19	26 Set 19	27 Set 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 896.1	1 895.8	2 181.4	2 096.3	2 198.6
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias autorizadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	30.0		30.0	30.0	
Proveídas recibidas	225.0		125.0	180.0	
Plazo de vencimiento	192.4		624.4	348.4	
Tasas de Inter Minería	2.19		2.38	2.32	
Máxima	2.29		2.40	2.30	
Promedio	2.27		2.39	2.36	
Saldo	28 600.7	28 600.7	28 630.7	28 660.7	28 660.7
Prestamo vencimiento de CD BCRP al 2 de octubre de 2019	450.0		450.0		450.0
Vencimiento de CD BCRP del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
ii. Subasta de Contratos Temporales de Valores (REPO)					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 800.0	3 800.0	3 800.0	3 800.0	3 800.0
Prestamo vencimiento de Repo de Valores al 3 de octubre de 2019	200.0		200.0		200.0
Vencimiento de REPO BCRP del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
iii. Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Prestamo vencimiento de COLD BCRP al	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de COLD BCRP del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	500.0		770.2	800.1	785.1
Proveídas recibidas	309.9	963.3	770.2	965.5	785.1
Plazo de vencimiento	1.6	1.4	1.4	1.4	3.6
Tasas de Inter Minería	1.70	1.80	2.00	2.04	1.90
Máxima	2.27	2.50	2.50	2.50	2.50
Promedio	2.27	1.96	2.18	2.31	2.40
Saldo	300.0	500.1	770.2	800.1	785.1
Prestamo vencimiento de Depósitos a Plazo al 30 de setiembre de 2019	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	300.0		770.2		785.1
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100.1	4 100.1	4 100.1	4 100.1	4 100.1
Prestamo vencimiento de Cobo-TP al 24 de octubre de 2019	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Cobo-TP del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Resaltados del BCRP (CDR BCRP)					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Prestamo vencimiento de CDR BCRP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Reconar)					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 750.1	11 750.1	11 750.1	11 450.1	11 450.1
Prestamo vencimiento de Repo Reconar al 28 de octubre de 2019	600.0		600.0		600.0
Vencimiento de REPO del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	800.0		800.0		800.0
viii. Compra con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Reconar)					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Prestamo vencimiento de Repo Reconar	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Reconar del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Reconoma de moneda extranjera (Sustitucion)					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Prestamo vencimiento de Repo Reconar	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Reconar del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 400.1	2 400.1	2 400.1	2 400.1	2 400.1
Prestamo vencimiento de SC-Venta al 4 de octubre de 2019	600.1		600.1		600.1
Vencimiento de SC - Venta del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Proveídas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Inter Minería					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Prestamo vencimiento de SC-Compra	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 30 de setiembre al 4 de octubre del 2019	0.0		0.0		0.0
xii. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0.0	0.0	0.5	0.0	15.0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP - CD BCRP-NR v BTP					
i. Compras de CD BCRP v CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 656.1	1 365.8	1 381.2	1 466.2	1 613.3
a. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones					
i. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.0075%	0.0075%	0.0075%	0.0075%	0.0084%
ii. Compra temporal directa de valores fuera de subasta	3.05%	3.05%	3.05%	3.05%	3.05%
iii. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	1.20%	1.20%	61.7	517.1	745.7
Deudados Overmirt en moneda nacional	5.0	161.0	1.20%	1.20%	1.20%
4. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 651.1	1 144.8	1 319.9	1 319.9	862.8
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 403.7	8 323.9	8 263.4	8 199.4	8 133.2
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.4	5.3	5.3	5.3	5.2
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 914.0	2 868.0	2 779.9	2 715.2	2 650.8
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.9	1.8	1.7	1.7	1.7
5. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	726.0	1 004.0	573.0	604.0	630.5
Tasas de Inter Minería - Máxima / Promedio	2,502,502.50	2,502,502.50	2,502,502.50	2,502,502.50	2,502,502.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	25.0	47.0	8.0	8.0	20.0
Tasas de Inter Minería - Máxima / Promedio	2,002,002.00	2,002,002.00	2,002,002.00	2,002,002.00	2,002,002.00
c. Total mercado secundario de COBCRP, COBCRP-NR v CDV					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
6. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Setiembre 19	23 Setiembre 19	24 Setiembre 19	25 Setiembre 19	26 Setiembre 19
Flujo de la posición global = a + b1 + c1 + e + f + g	45.4	10.0	45.4	45.4	45.1
Flujo de la posición contable = a + b1 + c1 + e + f + g	45.4	10.0	45.4	45.4	45.1
a. Mercado spot con el público					
i. Compras	339.0	319.0	230.3	307.1	362.7
ii. Ventas	293.6	292.7	373.5	312.5	488.4
iii. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	69.9	66.9	36.6	50.1	69.7
iv. Facturas	157.0	315.1	222.1	176.2	437.5
v. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	57.1	247.5	258.7	125.6	309.8
vi. Facturas	75.3	255.0	96.2	189.0	224.4
vii. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	214.3	416.9	237.6	387.0	491.2
viii. Facturas	139.0	211.9	333.8	277.9	515.8
b. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	603.0	690.7	655.0	495.0	841.7
ii. A plazo	10.0	10.0	70.0	70.0	70.0
iii. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	33.6	47.7	109.2	138.1	185.9
iv. Compras	107.3	187.9	307.4	233.3	456.4
v. Ventas	33.6	155.2	186.4	115.2	310.9
vi. Efecto de Operaciones	0.1	0.0	-1.3	0.0	1.9
vii. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0.1	0.1	0.4	0.4	0.2
viii. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datsic)	3.9597	3.3639	3.3448	3.3509	3.3658