

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	30 Set 19	01 Oct 19	02 Oct 19	03 Oct 19	04 Oct 19
	787,4	2 299,2	3 205,0	3 680,3	3 622,5
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP					
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
ii. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0			30,0	
Plazo de vencimiento	127,5			181,0	
Tasas de interés	185,4			365,4	
Máxima	2,18			2,30	
Promedio	2,26			2,30	
Saldo	28 690,7	28 690,7	28 690,7	28 314,7	28 314,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de octubre de 2019	450,0	450,0	450,0	450,0	1 124,5
Vencimiento de CD BCRP del 7 al 11 de octubre del 2019	450,0	450,0	450,0	1 124,5	1 124,5
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	600,0	200,0	200,0	300,0	800,0
Plazo de vencimiento	600,0	535,0	535,0	100,0	190,0
Tasas de interés	1,4	1,4	1,4	7,4	1,4
Máxima	2,55	2,55	2,55	2,75	2,65
Promedio	2,71	2,76	2,76	2,75	2,65
Saldo	4 300,0	5 800,0	5 800,0	4 700,0	4 400,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de octubre de 2019	500,0	2 000,0	2 000,0	1 100,0	800,0
Vencimiento de REPO BCRP del 7 al 11 de octubre del 2019	1 000,0	2 500,0	2 500,0	1 400,0	1 100,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación de Papeles del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas		300,0	200,0	0,0	300,0
Plazo de vencimiento		725,0	340,0		725,0
Tasas de interés		183,4	183,4		183,4
Máxima		3,20	3,00		3,20
Promedio		3,20	3,20		3,20
Saldo	11 450,1	11 750,1	11 550,1	11 850,1	11 250,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 29 de octubre de 2019	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Excepción	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Excepción del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1	1 800,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 4 de octubre de 2019	600,1	600,1	600,1	600,1	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 7 al 11 de octubre del 2019	600,1	600,1	600,1	1 500,1	800,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 7 al 11 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neocotización del BCRP					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público			3,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			3,0	0,0	0,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					

	1 287,4	4 889,2	4 505,0	4 650,3	4 422,5
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones					
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva directa)	0,0074%	0,0074%	0,0074%	0,0075%	0,0084%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	715,1	0,0	0,0	0,0	251,1
d. Deudados Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	542,3	4 899,2	4 505,0	4 650,3	4 171,4
Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/)) (*)	7 954,0	7 882,4	10 032,6	9 967,9	10 034,1
Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	5,1	5,1	5,4	5,4	6,4
Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	2 489,7	2 397,1	4 599,2	4 536,4	4 601,2
Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	1,6	1,5	2,0	2,0	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDICRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	869,5	488,3	549,7	697,1	635,3
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2.502.502,50	2.502.502,50	2.502.502,50	2.502.502,50	2.502.502,50
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio			18,0		33,0
c. Total mercado secundario de CDICRP- CDICRP-NR y CDV			2.002.002,00		2.002.002,00
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	27 Setiembre 19	30 Setiembre 19	01 Octubre 19	02 Octubre 19	03 Octubre 19
Pago de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-30,9	1,2	189,3	-33,2	-26,6
Pago de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-121,2	-100,2	51,3	-6,6	-20,9
Mercado spot con el público	-181,0	-188,0	32,6	-33,6	-78,7
I. Compras	428,0	394,7	413,6	316,9	296,3
II. Ventas	606,9	562,7	381,0	310,5	315,0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	220,4	152,6	138,3	181,2	-108,7
I. Pactadas	423,3	356,4	328,0	451,4	223,5
II. (+) Ventadas	203,0	203,8	189,7	219,9	332,2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	131,3	51,7	0,9	238,2	-32,4
I. Pactadas	290,7	126,8	382,5	428,9	882,7
II. (+) Ventadas	159,4	75,1	381,5	220,7	915,1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
I. Al contado	537,0	416,5	402,5	577,2	513,7
II. A futuro	75,0	0,0	20,0	50,0	70,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	22,0	-34,4	209,3	46,5	895,9
I. Compras	151,1	71,7	380,8	210,5	896,2
II. Ventas	129,1	106,1	171,5	164,0	235,3
f. Efecto de Opciones	-7,8	0,5	0,1	0,5	0,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
I. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	-5,8	-6,6	1,2	1,3	-25,1
Tasa de interés					
Nota: Tasa de mercado interbancario promedio (Fuente: DatoEco)	3,3875	3,3826	3,3911	3,3867	3,3758
(*) Tasa preferencial					