

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	11 Nov 19	12 Nov 19	13 Nov 19	14 Nov 19	15 Nov 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 627,8	5 510,5	5 607,3	5 590,6	4 400,9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	30,0	300,0	300,0	30,0	300,0
Propuestas recibidas	151,0	750,0	594,0	104,0	548,0
Plazo de vencimiento	178,4	356,4	178,4	357,4	357,4
Tasas de interés	2,10	2,18	2,13	2,17	2,20
Máxima	2,17	2,20	2,19	2,19	2,20
Promedio	2,14	2,20	2,18	2,19	2,20
Salto	27 643,1	28 068,0	28 759,0	29 428,0	29 726,0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de diciembre de 2019			1 726,5		1 726,5
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	3 100,0	3 100,0	3 100,0	3 100,0	3 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de noviembre de 2019			200,0		200,0
Vencimiento de Repo de Valores del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		200,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLO BCRP el					
Vencimiento de CDLO BCRP del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	500,0	850,0	1 000,0	1 500,0	1 400,1
Propuestas recibidas	1 736,3	1 351,2	1 336,2	1 574,0	2 234,6
Plazo de vencimiento	1,4	1,0	1,4	1,4	3,4
Tasas de interés	1,50	1,70	1,74	1,74	1,74
Máxima	2,06	2,05	2,10	2,25	2,10
Promedio	1,52	1,92	1,97	2,10	2,03
Salto	500,0	850,0	1 000,0	1 500,0	1 400,1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de noviembre de 2019			1 000,0		1 400,1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de noviembre de 2019			500,0		500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		500,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompensa de moneda extranjera (Requirir)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	11 550,1	11 550,1	11 550,1	11 550,1	11 550,1
Próximo vencimiento de Repo Requirir el 25 de noviembre de 2019			300,0		300,0
Vencimiento de REPO del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompensa de moneda extranjera (Exposición)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Exposición					
Vencimiento de REPO Exposición del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompensa de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas		300,0	300,0		
Plazo de vencimiento		62,4	62,4		
Tasas de interés		-0,35	-0,30		
Máxima		0,00	0,30		
Promedio		-0,20	0,00		
Salto	0,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de SC Venta el 13 de enero de 2020			600,0		600,0
Vencimiento de SC - Venta del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Salto	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 18 al 22 de noviembre del 2019			0,0		0,0
xii. Operaciones cambiarias en la Mesa de Asociación 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\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	35,8	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público			35,8		0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			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					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 597,8	4 600,5	3 877,3	3 360,8	2 760,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal directa de moneda extranjera (swap)					
Comisión tasa efectiva diaria	0,0075%	0,0075%	0,0074%	0,0074%	0,0075%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional	242,6	125,0	275,0	195,0	137,0
Tasa de interés	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 355,2	3 985,5	3 602,3	3 165,8	2 563,8
i. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	9 300,5	9 300,5	9 300,5	9 300,5	9 300,5
ii. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,9	6,0	6,0	5,9	5,9
iii. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	3 797,5	3 809,0	3 810,7	3 748,3	3 709,4
iv. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,4	2,4	2,4	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDR BCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	820,0	750,0	1 116,0	82,0	701,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	70,0	74,0	74,0	25,0	25,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75
c. Total mercado secundario de CDR BCRP, CDR BCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	08 Noviembre 19	11 Noviembre 19	12 Noviembre 19	13 Noviembre 19	14 Noviembre 19
Pago de la posición global = a + b + c + d + e + f + g	13,3	10,9	6,3	45,8	65,2
Pago de la posición corriente = a + b + c + d + e + f + g	13,3	10,9	6,3	45,8	65,2
a. Mercado spot con el público	35,6	13,7	55,2	110,1	228,5
i. Compras	309,8	251,1	284,1	419,6	245,2
ii. Ventas	386,3	242,4	329,6	309,5	317,7
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	211,1	101,0	233,1	101,0	182,4
i. Pactadas	430,0	112,5	391,0	311,3	137,4
ii. (i) Ventadas	116,9	11,6	137,1	160,7	205,6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	237,1	87,5	542,5	191,4	117,0
i. Pactadas	319,3	90,7	366,6	366,6	377,5
ii. (i) Ventadas	82,6	3,2	315,7	207,2	69,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al cobro	601,1	236,3	401,0	401,0	552,0
ii. Al pago	0,0	0,0	10,0	10,0	20,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	82,9	-1,6	173,9	32,0	287,9
i. Compras	87,0	28,1	289,1	289,1	614,2
ii. Ventas	173,9	4,0	115,2	117,7	325,4
f. Efecto de opciones	0,0	-1,1	-3,5	-3,5	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	5,7	-22,3	176,8	3,0	-9,7
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databeek)	3,3532	3,3642	3,3755	3,3938	3,3895
(*) Datos preliminares					