

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	09 Set 19	10 Set 19	11 Set 19	12 Set 19	13 Set 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 996,3	4 743,5	4 815,1	4 945,0	4 096,4
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCRP antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias avanzadas del BCRP					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50,0	300,0	50,0	300,0	199,9
Proveedores recibidos	152,5	536,0	114,0	150,0	537,0
Plazo de vencimiento	176 d	356 d	538 d	356 d	173 d
Tasas de Interés Mínima	2,27	2,31	2,34	2,31	2,26
Máxima	2,31	2,34	2,35	2,34	2,29
Promedio	2,29	2,32	2,35	2,33	2,28
Saldo	27 020,8	27 470,8	27 980,8	28 290,7	28 290,7
Primer vencimiento de CD BCRP el 2 de octubre de 2019	325,0	325,0	325,0	325,0	450,0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de setiembre del 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	0,0
ii. Subasta de Compras Temporales de Valores (REPO)	1,4	1,4	1,4	1,4	1,4
Proveedores recibidos	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de Interés Mínima	2,50	2,50	2,50	2,50	2,50
Máxima	2,50	2,50	2,50	2,50	2,50
Promedio	2,50	2,50	2,50	2,50	2,50
Saldo	4 200,0	3 800,0	3 800,0	3 800,0	3 800,0
Primer vencimiento de Repo de Valores el 3 de octubre de 2019	500,0	500,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 16 al 20 de setiembre del 2019	500,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Primer vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	0,0	547,9	1000,0	1000,0	1320,0
Proveedores recibidos	1,4	1438,9	1612,8	1612,8	1672,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de Interés Mínima	2,0	2,10	2,30	2,30	2,10
Máxima	2,50	2,50	2,50	2,50	2,27
Promedio	2,32	2,45	2,43	2,43	2,25
Saldo	0,0	500,0	1 000,0	1 300,0	1 300,0
Primer vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de setiembre de 2019	0,0	0,0	1 000,0	1 300,0	1 300,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	1 000,0	1 000,0	1 300,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público	0,0	0,0	1 000,0	1 000,0	1 300,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1
Primer 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 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reasustados del BCRP (CDR BCRP)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Primer vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con comprobante de Reconocimiento de moneda extranjera (Reacuar)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1
Primer vencimiento de Repo Recuar el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con comprobante de Reconocimiento de moneda extranjera (Escanion)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Primer vencimiento de Repo Escanion	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Escanion del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con comprobante de Reconocimiento de moneda extranjera (Sustitucion)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Primer vencimiento de Repo Sustitucion	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitucion del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1
Primer vencimiento de SC-Venta el 4 de octubre de 2019	600,1	600,1	600,1	600,1	600,1
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Proveedores recibidos	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de Interés Mínima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Primer vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 16 al 20 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Masa de Neoperuación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (Millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (Millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
c. Operaciones con el Tesoro Público (Millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (Millones de US\$) - Tesoro Público	3,0	3,0	3,0	3,0	3,0
ii. Ventas (Millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 469,3	3 943,5	3 465,1	3 136,0	2 736,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasas eficientes directas)	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0068%
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 resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	1 374,2	232,7	531,1	678,0	56,0
Deducción Overdraft en moneda nacional	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	3 095,2	3 719,8	2 934,0	2 517,0	2 740,4
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 032,1	3 444,8	3 418,7	3 245,5	3 152,0
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,2	6,0	6,0	5,9	5,8
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 116,2	3 938,0	3 917,3	3 735,9	3 642,1
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,6	2,6	2,4	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 128,9	1 524,5	1 692,5	1 586,0	1 601,5
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	2,292,292,25	2,592,292,21	2,592,292,21	2,592,292,21	2,592,292,20
Tasa de interés: Mifera / Mifera / Promedio	41,0	21,0	28,0	20,0	20,0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP NR y CDV	2,292,292,25	2,292,292,25	2,292,292,25	2,292,292,25	2,292,292,25
Tasa de interés: Mifera / Mifera / Promedio					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	06 Setiembre 19	09 Setiembre 19	10 Setiembre 19	11 Setiembre 19	12 Setiembre 19
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	107,9	441	693	583	321
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g	105,9	437,8	693	586	325,3
a. Mercado spot con el público	110,9	63,7	79,5	63	346,7
Compras	301,8	266,2	252,3	236,6	666,1
Ventas	412,8	336,0	331,6	344,4	419,4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	96,2	69,7	9,6	9,6	118,1
i. Ventas	154,0	124,4	143,3	121,9	211,7
ii. Ventas	57,8	54,7	295,6	112,3	328,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	96,1	23,9	77,7	36,6	186,6
i. Ventas	179,3	137,8	415,1	313,4	466,0
ii. Ventas	81,2	161,5	426,8	274,1	466,0
d. Operaciones financieras interbancarias					
i. Al contado	620,7	253,3	363,0	731,1	600,3
ii. Futuro	0,0	16,0	30,0	30,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	28,9	33,1	141,5	315,0	315,0
i. Compras	76,9	58,1	477,8	247,0	655,2
ii. Ventas	48,0	25,0	180,0	195,5	290,2
f. Efecto de Opciones	-0,1	0,1	0,2	3,1	1,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0,4	-0,5	-6,6	-2,4	3,4
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Saldo de las cuentas interbancario promedio Fuente: Database	3,939	3,942	3,945	3,946	3,928