

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU					
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS					
(Millones de Soles)					
	16 Set 19	17 Set 19	18 Set 19	19 Set 19	20 Set 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 489,6	3 460,0	2 946,6	2 476,5	2 262,1
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)					
Propuestas recibidas	50,0		50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	136,0		101,0	56,0	
Tasas de Interés Mínima	171 d		531 d	355 d	
Máxima	2,28		2,35	2,33	
Promedio	2,29		2,36	2,69	
Saldo	28 390,7	28 390,7	28 390,7	28 555,7	28 555,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de octubre de 2019	450,0	450,0	450,0	450,0	450,0
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 800,0	3 800,0	3 800,0	3 800,0	3 800,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de octubre de 2019	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1000,0	1000,0	700,0	500,0	363,7
Plazo de vencimiento	1875,9	2239,1	636,5	899,5	363,7
Tasas de Interés Mínima	1 d	1 d	1 d	1 d	3 d
Máxima	2,03	1,99	1,85	1,74	1,64
Promedio	2,09	2,0	1,75	2,50	2,50
Saldo	1 000,0	1 000,0	700,0	500,0	363,7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de setiembre de 2019	1 000,0	1 000,0	700,0	500,0	363,7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de setiembre del 2019	1 000,0	1 000,0	700,0	500,0	363,7
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
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 23 al 27 de setiembre 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 Mínima					
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 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1	11 750,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 26 de setiembre de 2019	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	800,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exposición)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Exposición	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Exposición del 23 al 27 de setiembre 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 Mínima					
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 23 al 27 de setiembre 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 Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1	2 400,1
Próximo 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 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de Interés Mínima					
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 23 al 27 de setiembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (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			5,2	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público			5,2		
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			0,0		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					

	2 439,6	2 460,0	2 196,6	1 926,5	1 898,4
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 439,6	2 460,0	2 196,6	1 926,5	1 898,4
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0085%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	9,0	45,0	365,3	156,0	512,5
d. Depósitos Overnigh 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	2 439,6	2 416,0	1 831,3	1 770,5	1 385,9
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 093,5	8 912,1	8 853,2	8 726,5	8 850,6
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,7	5,7	5,6	5,5
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 487,0	3 406,6	3 250,7	3 240,0	3 163,5
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,2	2,2	2,1	2,1	2,0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 635,5	1 119,8	1 198,5	1 011,0	598,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,50/2,55/2,51	2,50/2,50/2,50	2,50/2,50/2,50	2,50/2,55/2,51	2,50/2,50/2,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	26,0	76,0	13,0	26,0	30,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,00/2,00/2,00	2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)		20,0		50,0	5,3
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)				20/2,33	
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	13 Setiembre 19	16 Setiembre 19	17 Setiembre 19	18 Setiembre 19	19 Setiembre 19
Fujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-8,7	19,8	109,8	-106,8	-119,9
Fujo de la posición contable = a + b1 + c1 + e + f + g	-85,8	55,5	-81,8	-348,8	-191,1
a. Mercado spot con el público	-120,5	-8,0	-80,2	-363,9	-28,2
Compras	313,1	292,2	291,8	279,9	308,3
i. (i) Ventas	433,6	301,2	372,0	643,8	336,5
ii. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	5,1	-118,0	-87,7	290,7	-49,3
i. Pactadas	185,7	117,4	134,4	524,4	294,5
ii. (i) Ventas	188,6	236,4	192,1	233,8	343,9
iii. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-7,2	-83,2	-227,1	48,5	-44,4
i. Pactadas	309,2	193,8	183,8	281,6	625,9
ii. (i) Ventas	316,4	288,8	411,0	233,1	670,4
c. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	895,9	500,3	680,2	634,7	794,5
ii. A futuro	0,0	4,8	60,6	75,0	48,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	199,4	91,8	237,0	16,5	344,2
i. Compras	311,4	267,7	357,1	223,5	633,5
ii. (i) Ventas	112,0	169,0	120,1	207,0	289,3
f. Efecto de Dicciones	-1,1	-0,9	2,0	-0,1	4,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,1	4,2	0,4	-2,1	-8,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3156	3,3267	3,3439	3,3445	3,3544
(*) Datos preliminares					