

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	4 Nov 19	5 Nov 19	6 Nov 19	7 Nov 19	8 Nov 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 841,7	3 473,5	3 909,9	6 200,7	5 740,1
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
2.1. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	300,0
Plazo de vencimiento	156,2		74,0	257,5	842,0
Tasas de interés	185,4		545,4	362,4	361,4
Máxima	2,19		2,40	2,25	2,25
Mínima	2,22		2,25	2,25	2,23
Promedio	2,20		2,40	2,25	2,21
Saldo	27 945,1	27 945,1	27 975,1	26 545,1	27 103,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de noviembre de 2019	1 925,0		1 925,0		1 925,0
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de noviembre del 2019	1 925,0		1 925,0		1 925,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	2100,0	1500,0	1200,0		
Plazo de vencimiento	4600,0	3500,0	2400,0		
Tasas de interés	1,4	1,4	1,4		
Máxima	2,90	2,96	2,50		
Mínima	3,09	2,97	2,55		
Promedio	3,0	2,97	2,51		
Saldo	5 200,0	4 600,0	4 300,0	3 100,0	3 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de noviembre de 2019	2 100,0		1 200,0		200,0
Vencimiento de Repo Valores del 11 al 15 de noviembre del 2019	2 100,0		1 200,0		0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP a Plazo en Moneda Nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 800,1	1 300,1	1 300,1	800,1	500,0
Plazo de vencimiento	1328,1	1 328,1	1 328,1	1 971,2	1 440,0
Tasas de interés	1,4	1,4	1,4	1,4	3,4
Máxima	2,0	2,0	2,0	2,0	1,50
Mínima	2,50	2,42	2,42	2,42	2,12
Promedio	2,42	2,33	2,33	2,33	1,88
Saldo	0,0	0,0	0,0	800,1	500,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de noviembre de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	500,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación TP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	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		500,0
Vencimiento de Coloc TP del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustados del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
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 11 al 15 de noviembre 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					
Máxima					
Mínima					
Promedio					
Saldo	11 550,1	11 550,1	11 550,1	11 550,1	11 550,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 25 de noviembre de 2019	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de noviembre del 2019	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					
Mínima					
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 11 al 15 de noviembre 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					
Mínima					
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 11 al 15 de noviembre 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					
Mínima					
Promedio					
Saldo	300,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC Venta	300,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0		0,0		0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Mínima					
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 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en el Mercado 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	0,0	2,8	0,0	0,0	0,0
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					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Compras de BTP					

	4 911,7	4 973,5	5 079,9	5 070,6	4 748,1
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 911,7	4 973,5	5 079,9	5 070,6	4 748,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones:					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0081%	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0075%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%	2,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	8,0	8,0	8,0	10,0	20,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%	1,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 900,7	4 865,5	5 071,9	5 060,6	4 729,1
1 Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/)) (*)	7 987,5	8 596,3	8 596,3	8 503,6	8 120,6
2 Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	5,1	5,4	5,4	5,6	5,8
c Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	2 489,9	3 015,0	3 015,0	3 322,5	3 539,7
d Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% de TOSE)) (*)	1,8	1,9	1,9	2,1	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	878,0	713,6	878,4	834,8	1 482,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.502.502,50	2.502.502,50	2.502.502,50	2.502.502,50	2.252.502,28
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)		34,0	61,0	26,0	91,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		1.751.751,75	1.751.751,75	1.751.751,75	1.751.751,75
c. Total mercado secundario de CDBCRP- CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	31 Octubre 19	04 Noviembre 19	05 Noviembre 19	06 Noviembre 19	07 Noviembre 19
Pago de la posición contable = a + b - c + e + f + g	11,0	-1,2	17,3	42,0	26,3
Pago de la posición contable = a + b - c + e + f + g	4,9	-2,6	-70,6	20,8	29,6
a. Mercado spot con el público	1,6	-1,0	72,7	-19,8	26,9
i. Compras	82,7	349,5	269,4	268,5	323,4
ii. Ventas	81,0	370,6	342,1	278,2	296,7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	36,9	-12,0	117,7	255,1	13,8
i. Pactadas	-20,5	193,7	372,4	370,2	433,6
ii. (+) Vencidas	5,1	205,8	254,8	115,1	419,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	30,8	-13,7	56,6	233,9	8,9
i. Pactadas	32,3	318,5	301,3	303,3	793,5
ii. (+) Vencidas	1,5	332,3	359,9	69,4	784,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0,0	555,0	659,4	988,9	710,3
ii. A futuro	0,0	34,0	40,0	194,7	84,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	1,7	125,6	111,3	5,0	337,4
i. Compras	0,0	314,4	331,4	69,0	752,5
ii. (+) Ventas	1,7	188,8	220,0	74,0	415,0
f. Efecto de Opciones	0,0	-0,2	0,3	0,1	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,5	-8,6	-92,8	-0,2	-1,8
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Totales de mercado interbancario promedio (Fuente: Datoce)	3.3486	3.3486	3.3381	3.3402	3.3489
(*) Tasa preferencial					