BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	25 Nov 19	26 Nov 19	27 Nov 19	28 Nov 19	29 Nov 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**574,9**	**769,0**	**809,8**	**496,4**	**-640,4**
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		30.0	30.0	
Proouestas recibidas	190.3		167.5	194.0	
Plazo de vencimiento	169 d		554 d	371 d	
Tasas de inter Mínima	2.13		2.20	2.15	
Máxima	2.17		2.21	2.20	
Promedio	2.16		2.20	2.19	
Saldo	29 848.0	29 848.0	29 878.0	29 908.0	29 908.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de diciembre de 2019	1 726.5		1 726.5		1 726.5
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		1 726.5
ii. Subasta de Comora Temporal de Valores (REPO)	300.0 200.0	200.0	300.0	300.0	700.0 1150.0
Proouestas recibidas	820.0 350.0	300.0	541.0	445.0	1770.0 1970.0
Plazo de vencimiento	183 d 1 d	1 d	1 d	1 d	3 d 3 d
Tasas de inter Mínima	3.15 2.26	2.25	2.27	2.25	2.65 2.65
Máxima	3.15 2.26	2.25	3.0	2.33	2.65 3.13
Promedio	3.15 2.26	2.25	2.45	2.30	2.65 3.01
Saldo	3 300.0	3 300.0	3 400.0	3 400.0	4 950.0
Próximo vencimiento de Reoo de Valores el 2 de diciembre de 2019	200.0		300.0		1 850.0
Vencimiento de Reoo Valores del 2 al 6 de diciembre del 2019	200.0		300.0		2 250.0
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter 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 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		1300.1		1300.1	
Proouestas recibidas		1328.1		1328.1	
Plazo de vencimiento		1 d		1 d	
Tasas de inter Mínima		2.0		2.0	
Máxima		2.50		2.50	
Promedio		2.42		2.42	
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100.2	4 100.2	4 100.2	4 100.2	4 100.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 3 de diciembre de 2019	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		300.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter 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
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
vii. Comora con compromiso de Recompra de moneda extraniera (Reoular)					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 250.1	11 250.1	11 250.1	11 250.1	11 250.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de diciembre de 2019	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		700.0
viii. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Expansión)					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Reoo Exoansion	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Exoansión del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Reoo Sustitucion	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swao Cambiario Venta del BCRP					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600.0	600.0	600.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de enero de 2020	600.0		600.0		600.0
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swao Cambiario Comora del BCRP					
Proouestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter 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
Vencimiento de SC - Comora del 2 al 6 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	44.2
i. Comoras (millones de US$) - Tesoro Público	0.0		0.0		44.2
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público	0.0		0.0		0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP. CD BCRP-NR y BTP					
i. Comoras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Comoras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**1 044,9**	**969,0**	**1 079,8**	**766,4**	**1 209,6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comora temporal de moneda extranjera (swaos).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0074%	0.0074%	0.0074%	0.0074%	0.0084%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
c. Crédito por reaulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	326.4	323.7	130.0	7.2	522.6
Tasa de interés	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**718,5**	**645,3**	**949,8**	**759,2**	**687,0**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8 384,2	8 303,1	8 227,7	8 174,4	8 113,6
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,2	5,2	5,2	5,1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 770,3	2 688,5	2 612,8	2 557,5	2 495,5
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,7	1,7	1,6	1,6	1,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 277.0	938.5	1 131.5	1 507.0	1 342.5
Tasas de interés Mínima / Máxima / Promedio	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25	2.25/2.30/2.26	2.25/2.30/2.25
b. Operaciones a la vista en moneda extraniera (millones de US$)	80.0	25.0	6.0		20.0
Tasas de interés Mínima/ Máxima/ Promedio	1.7/1.75/1.75	1.7/1.75/1.75	1.7/1.75/1.75		1.75/1.75/1.75
c. Total mercado secundario de CDBCRP. CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa 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$)	**22 Noviembre 19**	**25 Noviembre 19**	**26 Noviembre 19**	**27 Noviembre 19**	**28 Noviembre 19**
Flujo de la posicion global = a + b.i - c.i + e + f + g	-56,4	66,7	-7,6	21,8	45,9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	220,7	51,1	-95,3	61,9	60,2
a. Mercado spot con el público	171,9	42,1	-109,6	30,2	15,7
i. Compras	395,2	295,9	329,7	444,9	292,3
ii (-) Ventas	223,2	253,8	439,3	414,7	276,6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-22,0	164,7	-155,1	-11,4	-2,5
i. Pactadas	142,0	265,2	288,8	228,6	129,7
ii (-) Vencidas	164,0	100,5	444,0	239,9	132,2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	256,1	133,6	-239,2	29,9	14,5
i. Pactadas	480,2	327,7	325,8	258,2	66,5
ii (-) Vencidas	224,1	194,1	565,0	228,3	52,0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	694,2	279,0	687,5	554,2	380,1
ii. A futuro	10,0	30,0	120,0	40,0	37,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	110,4	103,5	117,3	30,0	-59,3
i. Compras	222,3	191,8	516,3	224,7	23,7
ii (-) Ventas	111,8	88,3	399,0	194,7	83,0
f. Efecto de Opciones	0,9	-15,5	3,6	1,2	2,7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1,5	-0,9	18,1	-9,9	23,6
h. Crédito por reaulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3847	3,3889	3,3824	3,3935	3,3887
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera