

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	20 Ene 20	21 Ene 20	22 Ene 20	23 Ene 20	24 Ene 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 192,1	2 133,1	910,1	-289,6	103,2
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	80,5	142,0	30,0	30,0	133,0
Plazo de vencimiento	116,4	352,4	713,4	1076,4	1076,4
Tasas de interés	1,99	2,02	2,25	2,35	2,35
Máxima	2,13	2,12	2,25	2,35	2,35
Promedio	2,07	2,09	2,25	2,35	2,35
Saldo	28 324,4	28 364,4	28 364,4	28 444,4	28 444,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de febrero de 2020	1 407,0	1 407,0	1 407,0	1 407,0	1 407,0
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 31 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas			500,0	500,0	500,0
Plazo de vencimiento			990,0	1000,0	1000,0
Tasas de interés			1,4	1,4	1,4
Máxima			2,28	2,60	2,70
Promedio			2,50	2,60	2,91
Saldo	3 850,0	3 850,0	4 350,0	4 850,0	5 350,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores del 27 de enero de 2020	300,0	300,0	500,0	500,0	1 500,0
Vencimiento de Repo de Valores del 27 al 31 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 10 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 27 al 31 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1000,0	500,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	1158,7	619,3	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés	1,4	1,4	0,0	0,0	0,0
Máxima	1,68	1,50	0,0	0,0	0,0
Promedio	1,45	1,42	0,0	0,0	0,0
Saldo	1 000,0	500,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 31 de enero del 2020	1 000,0	500,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación OP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	1 000,0	500,0	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	1 000,0	500,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés	3,41	3,12	3,41	3,12	3,41
Máxima	3,41	3,12	3,41	3,12	3,41
Promedio	3,41	3,12	3,41	3,12	3,41
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de marzo de 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 27 al 31 de enero del 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
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 27 al 31 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Rescatar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de febrero de 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Exansión	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Exansión del 27 al 31 de enero del 2020	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					
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 27 al 31 de enero del 2020	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					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de febrero de 2020	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 31 de enero del 2020	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					
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 27 al 31 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación 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	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	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 v BTP					
i. Compras de CD BCRP - CD BCRP-NR					
ii. Contratos de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	7 162,1	6 083,1	1 380,1	1 216,4	1 663,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (forward)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0076%
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					
Tasa de interés	2,20%	3,07%	85,2	42,0	315,0
d. Depósitos Overnigth en moneda nacional					
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	8 939,1	1 286,1	1 284,9	1 168,4	1 288,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado millones de S/)	8 939,5	8 941,2	8 941,2	8 941,2	8 943,5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,5	5,4	5,4	5,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 230,4	3 179,7	3 064,8	2 982,3	2 906,7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	1,9	1,9	1,8	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 334,4	1 066,8	972,0	1 184,6	902,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,20/2,25/2,24	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\$)	15,0	15,0	15,0	15,0	15,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR v CDV	1 751/1 751/1 75	1 751/1 751/1 75		1 751/1 751/1 75	
Plazo (1 meses (monto) / tasa promedio)					
Plazo (2 meses (monto) / tasa promedio)					
Plazo (3 años (monto) / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	17 Enero 20	20 Enero 20	21 Enero 20	22 Enero 20	23 Enero 20
Flujo de la posición (debil = a + b1 - c1 + e + f + g)	-8,4	123,3	-8,9	8,9	112,2
Flujo de la posición (neto) = a + b1 - c1 + e + f + g	-123,1	241,3	-25,2	150,0	176,1
a. Mercado spot con el público	-75,5	250,8	-158,6	-28,9	178,2
i. Compras	109,9	428,8	428,7	428,7	511,4
ii. Ventas	344,9	177,9	343,7	267,1	335,2
iii. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-88,9	-10,7	-81,8	-81,8	-75,7
iv. Ventas	187,0	10,2	143,7	143,0	281,1
v. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	205,9	20,9	224,8	224,8	352,8
vi. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-65,0	107,3	-193,2	-51,8	7,2
c. Facturas	311,1	396,5	362,5	362,5	756,4
ii. Compras	416,8	52,3	362,3	398,5	749,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	499,5	486,6	688,8	631,0	754,8
ii. Al plazo	124,0	119,2	117,0	119,2	151,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	163,4	6,6	60,8	92,2	402,3
f. Compras	386,8	6,6	361,4	361,4	743,2
g. Ventas	193,4	0,0	291,5	269,2	340,9
h. Efectos de Cobranza	89,9	0,0	-7,7	-7,7	14,0
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-9,2	-3,8	-4,5	-4,6	-3,0
g. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalect)	3,3214	3,3201	3,3183	3,3143	3,3211
(*) Datos preliminares					