

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	17 Feb 20	18 Feb 20	19 Feb 20	20 Feb 20	21 Feb 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	7 047,6	6 180,9	5 311,2	4 353,8	2 188,9
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)	30,0 100,0 300,0 300,0	30,0 300,0 300,0	30,0 300,0 300,0	30,0 100,0 200,0	30,0 100,0 200,0
Propuestas recibidas	117,4 212,0 1033,0 1167,0	127,6 686,0 1028,0	66,0 610,0 944,0	65,0 204,0 421,0	65,0 204,0 421,0
Plazo de vencimiento	171,4 687,4 353,4 171,4	137,6 37,4 170,4	66,0 356,4 168,4	1048,4 355,4 168,4	1048,4 355,4 168,4
Tasas de interés	Mínima 2,07 2,17 2,09 2,07	2,09 2,09 2,08	2,19 2,10 2,07	2,27 2,14 2,12	2,28 2,17 2,14
Máxima	2,08 2,19 2,09 2,08	2,10 2,11 2,08	2,21 2,14 2,12	2,28 2,16 2,13	2,28 2,16 2,13
Promedio	2,07 2,18 2,09 2,08	2,09 2,10 2,08	2,20 2,13 2,11	2,28 2,16 2,13	2,28 2,16 2,13
Saldo	29 220,7	29 957,7	30 487,7	30 817,7	30 817,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de marzo de 2020			1 757,9		1 757,9
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de febrero del 2020			0,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 850,0	3 850,0	3 850,0	3 850,0	3 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de marzo de 2020			300,0		300,0
Vencimiento de Repo de Valores del 24 al 28 de febrero del 2020			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 CULD BCRP el 1					
Vencimiento de CULD BCRP del 24 al 28 de febrero del 2020					
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 CULD BCRP el 1					
Vencimiento de CULD BCRP del 24 al 28 de febrero del 2020					
Propuestas recibidas	1499,9 2300,0	1500,0 1641,8	1499,9 931,2 500,0 594,5	2000,0 1000,0	700,0 600,0
Plazo de vencimiento	1,4 1,4	1,4 1,4	1,4 1,4 1,4 1,4	1,4 1,4	3,4 3,4
Tasas de interés	Mínima 2,10 2,07	2,19 2,14	2,15 2,10 2,10	2,20 2,13	2,05 2,10
Máxima	2,23 2,25	2,23 2,25	2,24 2,25 2,23 2,25	2,25 2,25	2,23 2,24
Promedio	2,22 2,15	2,22 2,20	2,20 2,24 2,15 2,24	2,24 2,20	2,22 2,21
Saldo	3 799,9	3 141,8	3 525,6	3 000,0	1 300,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 24 de febrero de 2020			3 525,6		1 300,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 24 de febrero del 2020			3 525,6		1 300,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Cobro TP el 2 de marzo de 2020			200,0		200,0
Vencimiento de Cobro TP del 24 al 28 de febrero del 2020			0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados 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					
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 28 de febrero del 2020					
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resuan)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1	10 250,1
Próximo vencimiento de Repo Requiere el 21 de febrero de 2020			800,0		600,0
Vencimiento de Repo del 24 al 28 de febrero del 2020			800,0		600,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exaración)					
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 Exaración					
Vencimiento de Repo Exaración del 24 al 28 de febrero del 2020					
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					
Vencimiento de Repo Sustitución del 24 al 28 de febrero del 2020					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	525,5	525,5	525,5	525,5	525,5
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de marzo de 2020			300,0		300,0
Vencimiento de SC - Venta del 24 al 28 de febrero del 2020			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					
Vencimiento de SC - Compra del 24 al 28 de febrero del 2020					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)					
iii. Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	5,5	0,4	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	5,5	0,4	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 / CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	2 517,8	2 388,1	1 155,6	1 023,8	888,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. 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 revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	6,4	6,4	10,8	7,0	7,0
d. Depósitos Overmiffi en moneda nacional	200,0	1 005,0	1 005,0	1 005,0	1 005,0
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	2 227,6	2 382,7	1 144,8	1 023,8	812,9
f Fondos de encargo en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	9 252,3	9 332,2	9 332,3	9 152,2	9 066,0
g Fondos de encargo en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,7	5,6	5,5	5,5
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	0 557,1	3 401,9	3 423,5	3 251,1	3 145,1
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,1	2,0	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	812,0	784,1	1 097,4	883,5	1 140,7
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,002/252/19	2,002/252/22	2,152/252/20	2,202/252/24	2,202/252/25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	71,5	97,5	34,0	53,3	52,2
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,751/751/75	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 6 meses (monto / tasa promedio)	236,6	237,7	186,1	61,0	202,18
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	236,6	237,7	186,1	61,0	202,18
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)	236,6	237,7	186,1	61,0	202,18
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	14 Febrero 20	17 Febrero 20	18 Febrero 20	19 Febrero 20	20 Febrero 20
Flojo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-29,1	-8,8	-1,8	-15,3	-16,5
Flojo de la posición controlada = a + b - c + e + f + g	45,2	5,7	-149,8	-11,3	-11,3
a. Mercado spot con el público	45,2	8,1	-138,4	-44,3	-44,3
i. Compras	285,3	205,0	285,3	284,4	284,4
ii. Ventas	347,6	201,4	454,9	388,7	388,7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	56,4	5,5	194,4	196,8	196,8
i. Pacjetas	114,3	20,7	230,8	255,6	255,6
ii. (i) Ventas	114,3	20,7	181,1	141,1	141,1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	20,2	16,3	48,1	210,9	210,9
i. Pacjetas	236,6	237,7	207,4	60,9	60,9
ii. (i) Ventas	216,5	6,5	210,7	104,2	104,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	492,0	178,2	765,2	696,2	696,2
ii. A plazo	74,0	85,0	74,0	74,0	74,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	97,3	-10,4	58,0	172,1	616,3
i. Compras	186,5	33,0	171,0	33,0	1010,9
ii. Ventas	87,2	15,6	113,0	165,8	394,7
f. Efectos de Opciones	0,1	0,3	0,3	0,3	0,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,8	1,7	-0,2	1,2	8,7
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databank)	3,3828	3,3825	3,3850	3,3832	3,3815