



Resumen Informativo Semanal

29 de octubre de 2020

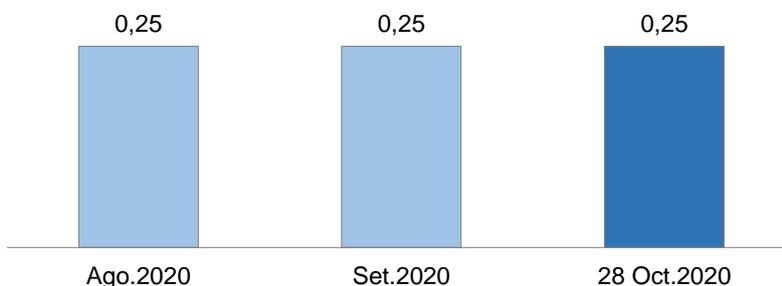
CONTENIDO

• Tasa de interés interbancaria en soles fue 0,25 por ciento el 28 de octubre	ix
• Operaciones del BCRP	xi
• Curvas de rendimiento de corto plazo	xv
• Bonos del Tesoro Público	xv
• Reservas Internacionales en US\$ 73 309 millones al 28 de octubre	xvi
• Mercados Internacionales	xvii
Disminuyen los precios de los metales en los mercados internacionales	xvii
Bajan los precios del trigo y del maíz en los mercados internacionales	xviii
Dólar se apreció en los mercados internacionales	xix
Riesgo país se ubicó en 152 puntos básicos	xx
Rendimiento de los US Treasuries se ubicó en 0,77 por ciento	xxi
• Índices de la Bolsa de Valores de Lima	xxi

TASA DE INTERÉS INTERBANCARIA EN SOLES FUE 0,25 POR CIENTO EL 28 DE OCTUBRE

El 28 de octubre, la tasa de interés **interbancaria** en soles fue 0,25 por ciento anual y esta tasa en dólares también se ubicó en 0,25 por ciento anual.

Tasa de interés interbancaria en soles
(%)



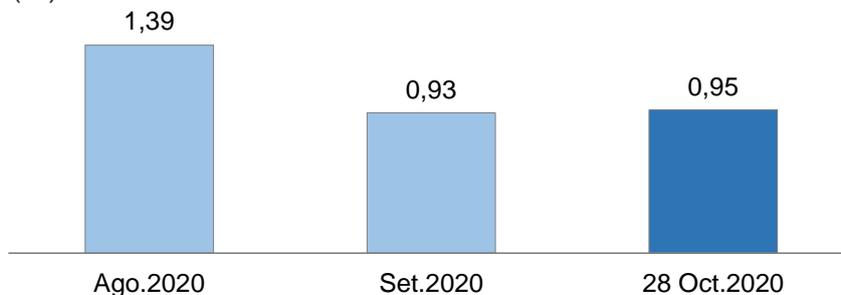
Para el mismo día, la tasa de interés **preferencial corporativa a 90 días** –la que se cobra a las empresas de menor riesgo– en soles se ubicó en 0,78 por ciento anual, mientras que esta tasa en dólares fue 0,91 por ciento anual.

Tasa de interés preferencial corporativa a 90 días en soles
(%)



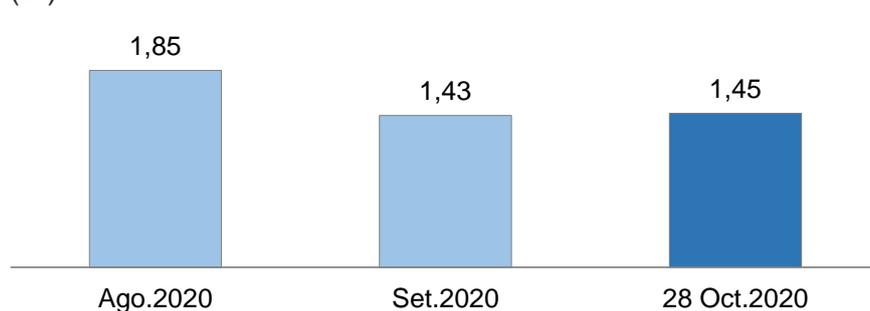
El 28 de octubre, la tasa de interés preferencial corporativa para **préstamos a 180 días** en soles fue 0,95 por ciento anual y esta tasa en dólares fue 1,11 por ciento anual.

Tasa de interés preferencial corporativa a 180 días en soles
(%)



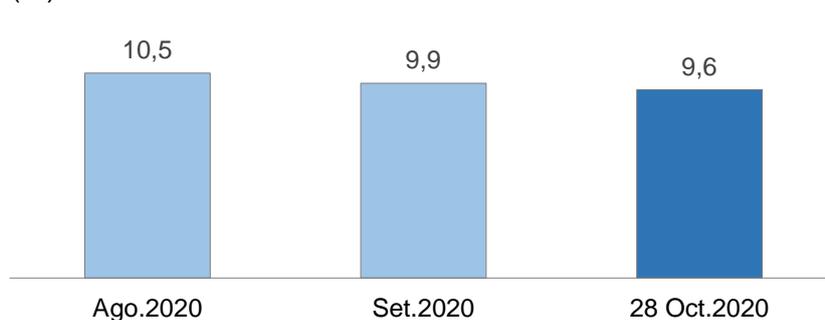
Para el mismo día, la tasa de interés preferencial corporativa para **préstamos a 360 días** en soles fue 1,45 por ciento anual y la de dólares se ubicó en 1,53 por ciento anual.

Tasa de interés preferencial corporativa a 360 días en soles
(%)

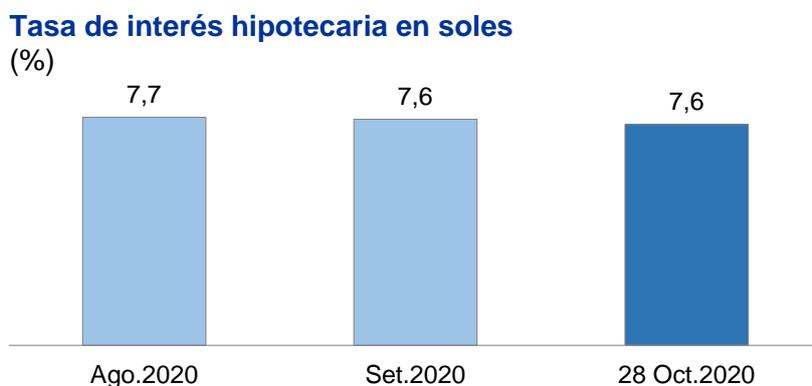


La tasa de interés para las **micro y pequeñas empresas (Mypes) a más de 360 días** en soles fue 9,6 por ciento anual y esta tasa en dólares se ubicó en 5,5 por ciento anual el 28 de octubre.

Tasa de interés a las Mypes a más de 360 días en soles
(%)



El 28 de octubre, la tasa de interés **hipotecaria** en soles fue 7,6 por ciento anual y en dólares, 6,7 por ciento anual.



OPERACIONES DEL BCRP

Las **operaciones monetarias** del BCRP en octubre fueron las siguientes:

- Operaciones de **inyección** de liquidez:
 - Repos de monedas: Al 28 de octubre, el saldo de Repos de monedas regular fue de S/ 5 695 millones con una tasa de interés promedio de 2,9 por ciento. El saldo al cierre de setiembre fue de S/ 5 895 millones con una tasa de interés promedio de 3,0 por ciento.
 - Repos de valores: Al 28 de octubre, el saldo fue de S/ 5 759 millones con una tasa de interés promedio de 1,4 por ciento. El saldo a fines de setiembre fue de S/ 8 604 millones con similar tasa de interés promedio.
 - Repos de cartera: Al 28 de octubre, el saldo fue de S/ 350 millones con una tasa de interés promedio de 0,6 por ciento. El saldo al cierre de setiembre fue de S/ 304 millones con similar tasa de interés promedio.
 - Repos con garantía del Gobierno: Al 28 de octubre, el saldo liquidado fue de S/ 49 453 millones, el cual, bajo el Programa Reactiva, se destinarían a créditos a una tasa de interés promedio de 1,4 por ciento. A fines de setiembre, el saldo fue de S/ 47 002 millones, con una tasa de interés promedio para los créditos de 1,3 por ciento.
 - Subastas de fondos del Tesoro Público: El saldo de este instrumento al 28 de octubre fue de S/ 2 000 millones con una tasa de interés promedio de 3,5 por ciento. El saldo a fines de setiembre fue de S/ 2 500 millones con similar tasa de interés promedio.

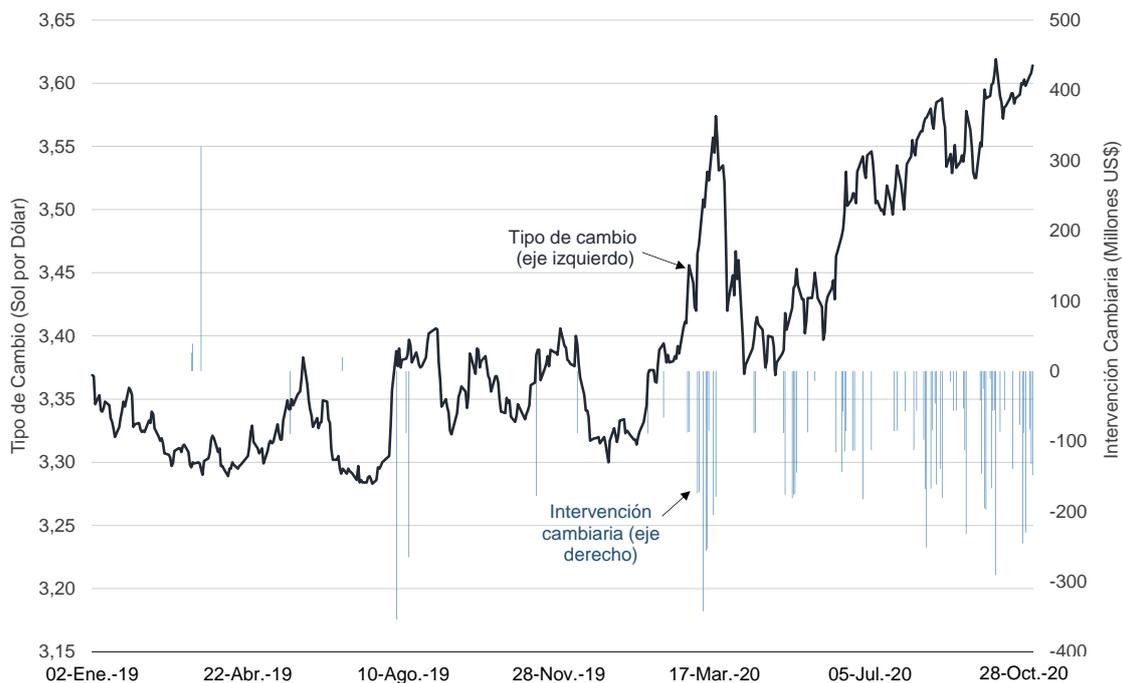
- Operaciones de **esterilización** de liquidez:
 - CD BCRP: El saldo al 28 de octubre fue de S/ 38 933 millones con una tasa de interés promedio de 0,9 por ciento, mientras que este saldo a fines de setiembre fue de S/ 38 639 millones, con tasa de interés promedio de 1,0 por ciento. En el periodo del 21 al 28 de octubre, las colocaciones de CDBCRP fueron S/ 720 millones a una tasa de interés promedio de 0,26 por ciento.
 - Depósitos *overnight*: Al 28 de octubre, el saldo de este instrumento fue de S/ 4 917 millones con una tasa de interés promedio de 0,2 por ciento. El saldo al cierre de setiembre fue de S/ 8 118 millones con la misma tasa de interés promedio.
 - Depósitos a plazo: Al 28 de octubre, el saldo de depósitos a plazo fue de S/ 33 692 millones con una tasa de interés promedio de 0,3 por ciento. El saldo a fines de setiembre fue de S/ 29 234 millones con la misma tasa de interés promedio.

En las **operaciones cambiarias**, al 28 de octubre, el BCRP tuvo una posición vendedora neta en el mercado cambiario por US\$ 1 050 millones.

- i. Intervención cambiaria: El BCRP vendió US\$ 12 millones el día 2 y US\$ 10 millones el 28 de octubre en el mercado *spot*.
- ii. *Swap* cambiarios venta: El saldo de este instrumento al 28 de octubre fue de S/ 6 774 millones (US\$ 1 887 millones), con una tasa de interés promedio de 0,05 por ciento. El saldo al cierre de setiembre fue de S/ 4 927 millones (US\$ 1 379 millones), con una tasa de interés promedio negativa de 0,1 por ciento.
- iii. CDR BCRP: El saldo de este instrumento al 28 de octubre fue de S/ 6 918 millones (US\$ 1 929 millones), con una tasa de interés promedio de 0,09 por ciento. El saldo al cierre de setiembre fue de S/ 5 040 millones (US\$ 1 410 millones), con una tasa de interés promedio de 0,07 por ciento.

El **tipo de cambio** venta interbancario cerró en S/ 3,61 por dólar el 28 de octubre, mayor en 0,4 por ciento en comparación a la cotización de fines de setiembre, acumulando un incremento de 9,1 por ciento en lo que va del año.

Tipo de cambio e intervención cambiaria del BCRP 1/

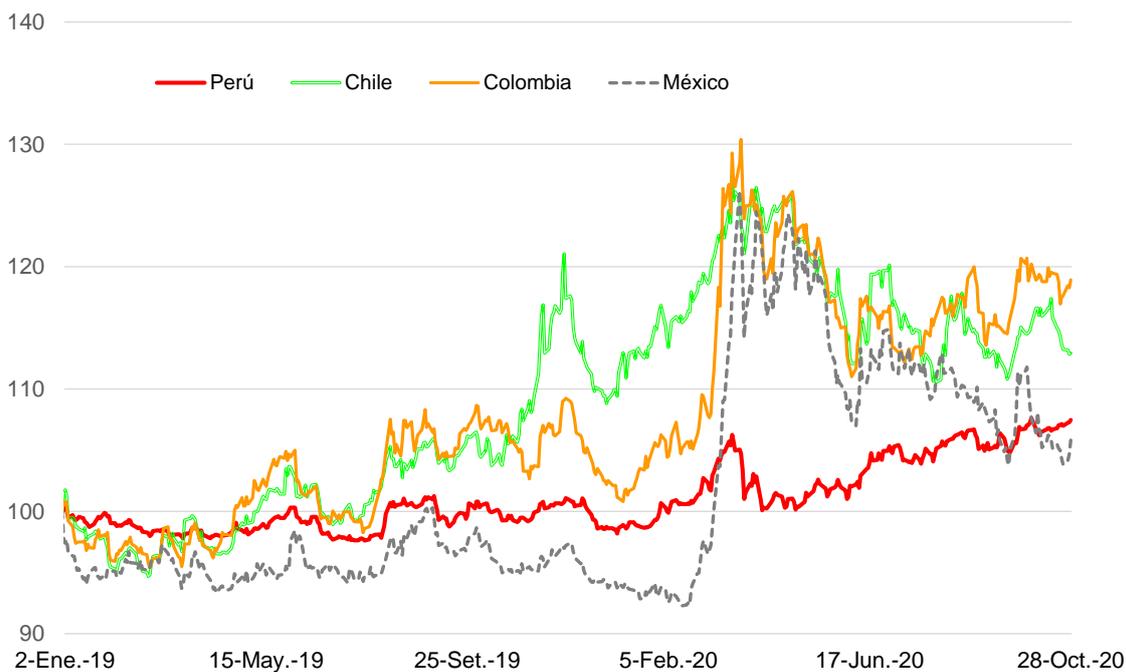


1/ Incluye: Compras/ventas de dólares en el mercado *spot* y colocaciones de CDR BCRP y *swaps* cambiarios.

La moneda peruana continúa siendo una de las de menor volatilidad frente al dólar dentro del grupo de economías de la Alianza del Pacífico.

Indices de tipo de cambio nominal

(Diciembre 2018 = 100)



Al 28 de octubre, la **emisión primaria** aumentó en S/ 357 millones respecto al cierre de setiembre. Ello se explicó principalmente por la mayor demanda de billetes y monedas por parte del público. Por su parte, se registró una reducción de los depósitos del Sector Público por S/ 4 355 millones.

En este contexto, el BCRP inyectó liquidez mediante la liquidación neta de Repos de Cartera con Garantía Estatal (S/ 2 451 millones). Dichas operaciones fueron compensadas parcialmente por la colocación neta de CDR BCRP (S/ 1 878 millones), la colocación neta de depósitos a plazo y *overnight* (S/ 1 257 millones), el vencimiento de Fondos del Tesoro Público a plazo (S/ 500 millones), la colocación neta de CD BCRP (S/ 295 millones) y el vencimiento neto de operaciones de inyección por un total de S/ 2 999 millones.

En los últimos 12 meses la emisión primaria se incrementó en 33,1 por ciento, como consecuencia principalmente de un aumento de 33,7 por ciento de los billetes y monedas emitidos.

Balance Monetario del Banco Central de Reserva del Perú

(Millones S/)

	Saldos				Flujos		
	Dic.19	Ago.20	Set.20	28 Oct.20	2020	Set.20	28 Oct.20
I. RESERVAS INTERNACIONALES NETAS	226 126	264 324	260 474	264 645	16 976	-8 228	3 432
<i>(Millones US\$)</i>	68 316	74 668	72 354	73 309	4 993	-2 314	955
1. Posición de cambio	42 619	55 324	55 250	55 474	12 855	-75	225
2. Depósitos del Sistema Financiero	17 096	16 869	14 726	15 862	-1 234	-2 143	1 136
3. Depósitos del Sector Público	9 188	3 024	2 924	2 515	-6 673	-101	-408
4. Otros	-588	-550	-546	-543	45	4	3
II. ACTIVOS INTERNOS NETOS	-161 561	-185 296	-182 005	-185 818	-2 714	7 669	-3 075
1. Sistema Financiero en moneda nacional	-6 230	-11 668	-13 725	-18 203	-11 973	-2 057	-4 478
a. Compra temporal de valores	6 350	11 379	8 604	5 759	-591	-2 775	-2 845
b. Operaciones de reporte de monedas	11 050	6 895	5 895	5 695	-5 355	-1 000	-200
c. Compra temporal de Cartera	0	250	304	350	350	55	46
d. Compra temporal de Cartera con Garantía Estatal ^{1/}	0	42 363	47 002	49 453	49 453	4 640	2 451
e. Valores Emitidos	-25 615	-37 929	-40 679	-42 851	-17 237	-2 749	-2 173
i. CDBCRP	-25 615	-34 919	-35 639	-35 933	-10 319	-719	-295
ii. CDRBCRP	0	-3 010	-5 040	-6 918	-6 918	-2 030	-1 878
f. Subasta de Fondos del sector público	4 100	2 500	2 500	2 000	-2 100	0	-500
g. Otros depósitos en moneda nacional	-2 115	-37 125	-37 351	-38 609	-36 493	-227	-1 257
2. Sector Público (neto) en moneda nacional ^{2/}	-52 125	-71 412	-69 811	-65 456	-13 330	1 601	4 355
3. Sistema Financiero en moneda extranjera	-56 587	-59 716	-53 014	-57 261	4 196	7 619	-4 082
<i>(Millones US\$)</i>	-17 096	-16 869	-14 726	-15 862	1 234	2 143	-1 136
a. Depósitos en moneda extranjera	-17 096	-16 869	-14 726	-15 862	1 234	2 143	-1 136
4. Sector Público (neto) en moneda extranjera	-28 409	-8 502	-8 311	-6 841	22 739	331	1 487
<i>(Millones de US\$)</i>	-8 583	-2 402	-2 309	-1 895	6 688	93	414
5. Otras Cuentas	-18 210	-33 999	-37 144	-38 058	-4 345	175	-357
III. EMISIÓN PRIMARIA (I+II) ^{3/}	64 565	79 028	78 469	78 826	14 261	-559	357
<i>(Var. % 12 meses)</i>	5,2%	30,9%	32,8%	33,1%			

1/. Monto liquidado.

2/. Sector Público excluye la subasta de Fondos de Tesoro Público y del Banco de la Nación.

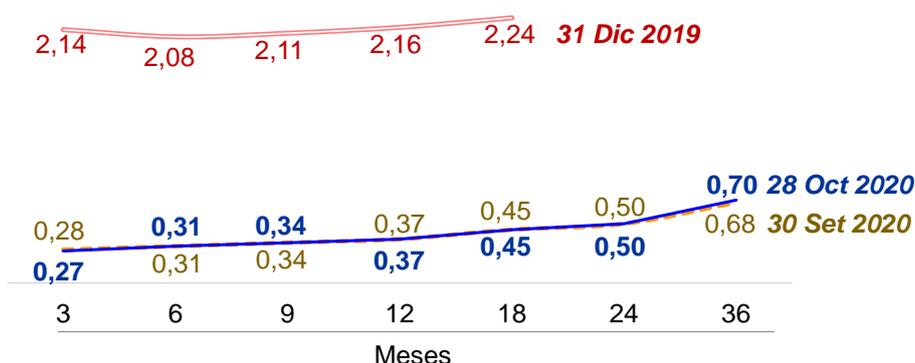
3/. Circulante más fondos de encaje en moneda nacional.

CURVAS DE RENDIMIENTO DE CORTO PLAZO

En lo que va de octubre, al día 28, la curva de rendimiento de CD BCRP registró, en comparación con la del cierre de setiembre, un comportamiento similar. Los Certificados de Depósito del BCRP son un instrumento de esterilización monetaria que puede ser negociado en el mercado o usado en repos interbancarios y repos con el BCRP. La forma de esta curva de rendimiento es influenciada por las expectativas de tasas futuras de política monetaria y por las condiciones de liquidez en el mercado.

Curva de rendimiento de CDBCRP

(%)

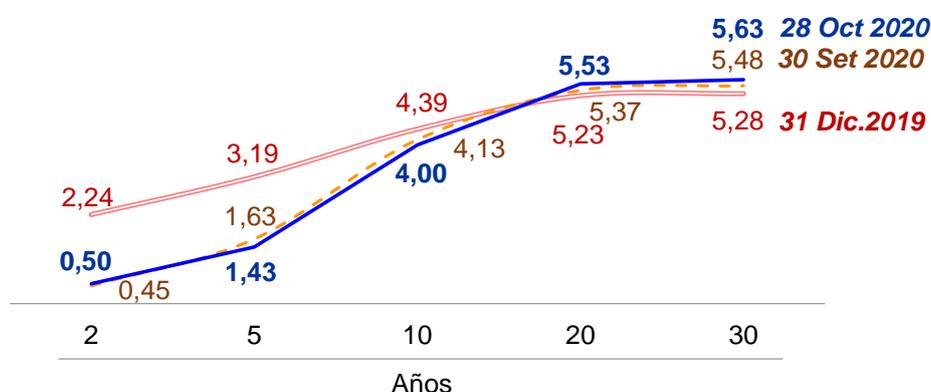


BONOS DEL TESORO PÚBLICO

Para plazos desde 2 años, los mercados toman como referencia a los rendimientos de los bonos del Tesoro Público. Al 28 de octubre de 2020, la curva de rendimiento de los bonos soberanos registró, en comparación con la de fines de setiembre, valores mayores para los plazos de 2, 20 y 30 años; mientras que, para los plazos de 5 y 10 años, estos fueron menores. Con respecto a la del cierre de 2019, muestra tasas menores en todos los plazos, con excepción de 20 y 30 años.

Curva de rendimiento de bonos del Tesoro

(%)

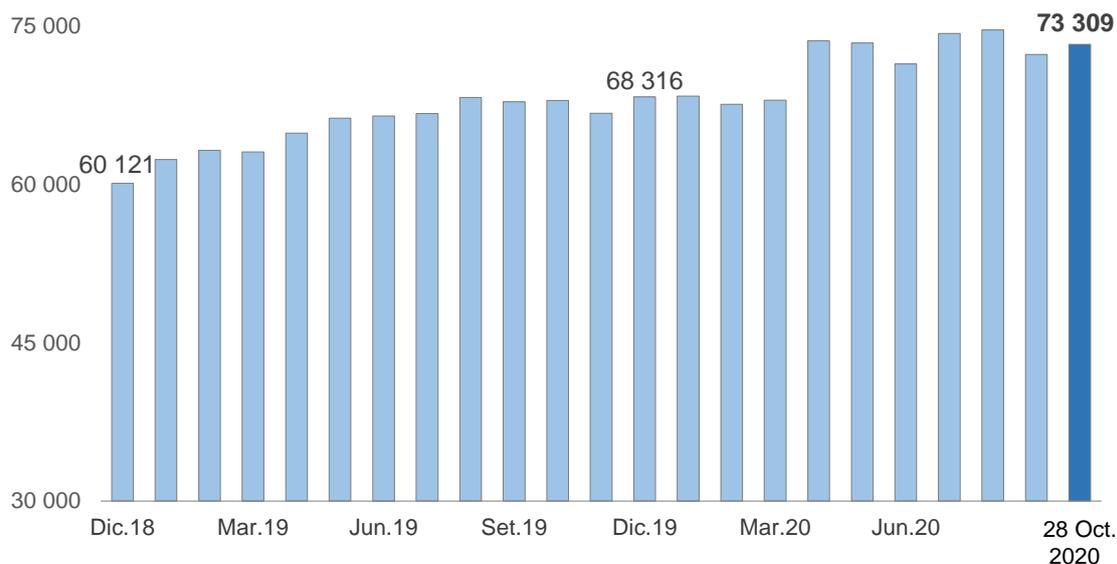


RESERVAS INTERNACIONALES EN US\$ 73 309 MILLONES AL 28 DE OCTUBRE

Al 28 de octubre de 2020, el nivel de **Reservas Internacionales Netas (RIN)** totalizó US\$ 73 309 millones, mayor en US\$ 955 millones al del cierre de setiembre y superior en US\$ 4 993 millones al registrado a fines de diciembre de 2019. Las RIN están constituidas por activos internacionales líquidos y su nivel actual es equivalente a 34 por ciento del PBI.

Reservas Internacionales Netas

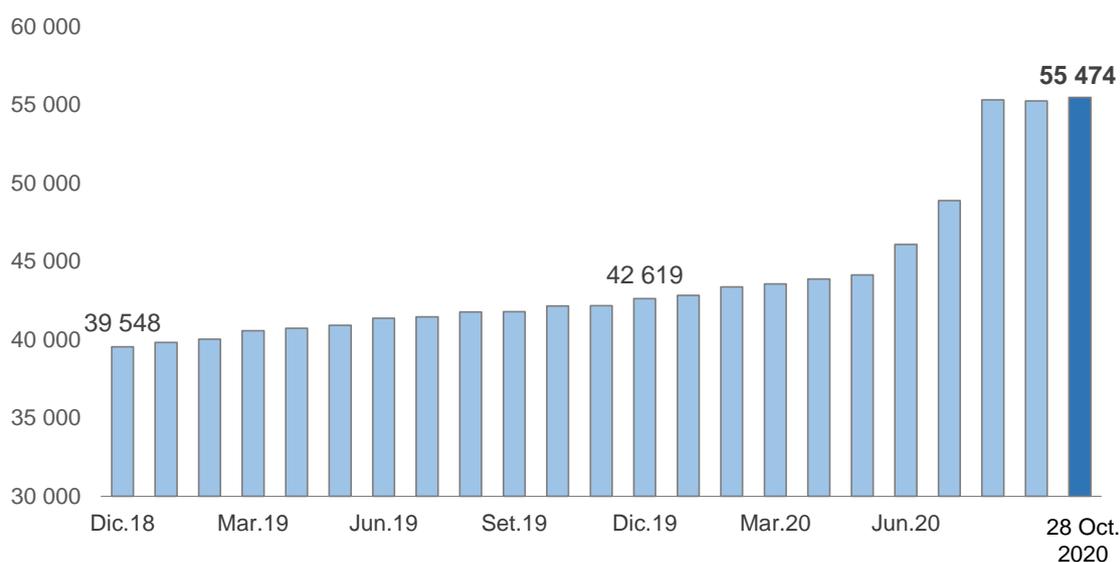
(Millones de US\$)



La **Posición de Cambio** al 28 de octubre fue de US\$ 55 474 millones, monto superior en US\$ 12 855 millones al registrado a fines de diciembre de 2019.

Posición de cambio

(Millones de US\$)



MERCADOS INTERNACIONALES

Disminuyen los precios de los metales en los mercados internacionales

El 28 de octubre, el precio del **cobre** se ubicó en US\$/lb. 3,05 disminuyendo 3,6 por ciento respecto al 21 de octubre. La reducción en el precio reflejó los temores de mayores restricciones por aumento de casos de Covid-19 en Estados Unidos y Europa y la postergación de las negociaciones para nuevos estímulos fiscales en Estados Unidos.

Cotización del Cobre

(ctv. US\$/lb.)



Variación %			
28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 3,05 / lb.	-3,6	0,9	9,4

Entre el 21 y el 28 de octubre, el precio del **zinc** disminuyó 1,3 por ciento a US\$/lb. 1,14.

La disminución en el precio se asoció al aumento de inventarios, principalmente en la Bolsa de Metales de Londres.

Cotización del Zinc

(ctv. US\$/lb.)



Variación %			
28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 1,14 / lb.	-1,3	5,5	10,5

El 28 de octubre, el precio del **oro** se ubicó en US\$/oz.tr. 1 870, disminuyendo 2,8 por ciento en comparación al 21 de octubre. Este resultado estuvo asociado a la apreciación de la divisa norteamericana de los últimos días y a las pocas expectativas del mercado de obtener un paquete de ayuda por el coronavirus por parte de Estados Unidos antes de las elecciones presidenciales.

Cotización del Oro

(US\$/oz.tr.)



Variación %			
28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 1 870,0 / oz tr.	-2,8	-0,9	22,8

Del 21 al 28 de octubre el precio del petróleo **WTI** disminuyó 6,5 por ciento a US\$/bl 37,3. El menor precio se sustentó en el aumento de los inventarios de petróleo crudo estadounidense y en el incremento de las infecciones por Covid en Estados Unidos y Europa, que debilitaron la demanda por combustibles.

Cotización del Petróleo (US\$/bl.)



28 Oct.2020	Variación %		
	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 37,3 / barril.	-6,5	-6,9	-39,0

Bajan los precios del trigo y del maíz en los mercados internacionales

Del 21 al 28 de octubre, el precio del **trigo** se redujo 4,0 por ciento a US\$/ton. 232,7.

El precio disminuyó luego de una mejora en las condiciones climáticas en Rusia, donde lluvias en algunas regiones alivian la sequía.

Cotización del trigo (US\$/ton.)



28 Oct.2020	Variación %		
	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 232,7 / ton.	-4,0	5,6	8,8

En el mismo periodo, el precio del **maíz** bajó 1,3 por ciento a US\$/ton. 153,1.

La caída del precio fue reflejo del mejor clima en América del Sur.

Cotización del maíz (US\$/ton.)



28 Oct.2020	Variación %		
	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 153,1 / ton.	-1,3	9,3	6,3

El precio del aceite de **soya** aumentó 0,6 por ciento a US\$/ton. 758,8 del 21 al 28 de octubre. El precio fue apoyado por un aumento de la demanda del grano estadounidense por parte de China principalmente, reportado por el Departamento de Agricultura de los Estados Unidos.

Cotización del aceite soya (US\$/ton.)



Variación %			
28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
US\$ 758,8 / ton.	0,6	1,6	-2,1

Dólar se apreció en los mercados internacionales

Del 21 al 28 de octubre, el **dólar** se apreció respecto al **euro**, en medio de una mayor demanda de activos seguros por nuevas medidas de cuarentenas en Europa, tras rebrote record de Covid, ruido político y pesimismo en negociaciones fiscales en Estados Unidos.

Cotización del US Dólar vs. Euro (US\$/Euro)



Variación %			
28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
1,17 US\$/euro	-1,0	0,2	4,8

El dólar norteamericano se ha debilitado en los últimos meses aunque en la última semana se apreció por la mayor aversión al riesgo, tal como se observa en el **Índice DXY**.

Índice DXY (Marzo 1973=100)

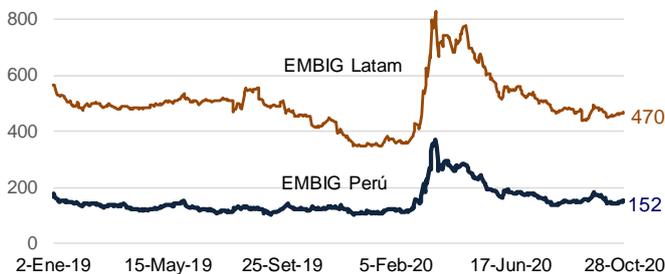


Variación %			
28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
93,4	0,8	-0,4	-3,1

Riesgo país se ubicó en 152 puntos básicos

Entre el 21 y el 28 de octubre, el *spread* **EMBIG Latinoamérica** se incrementó 7 pbs a 470 pbs, en medio de temores por aumento de casos de Covid en Europa y Estados Unidos. El 28 de octubre el *spread* **EMBIG Perú** se ubicó en 152 pbs.

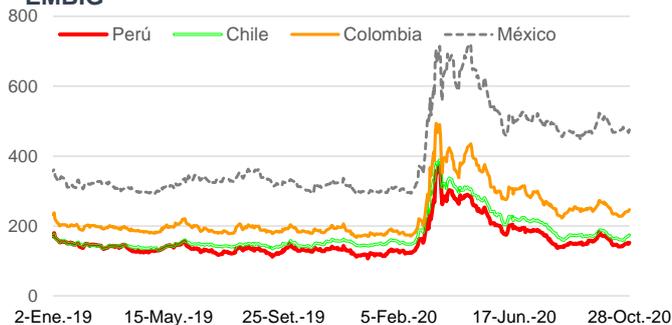
Indicadores de Riesgo País (Pbs.)



	Variación en pbs.			
	28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
EMBIG Perú (Pbs)	152	7	-18	45
EMBIG Latam (Pbs)	470	7	-6	124

El *spread* del **EMBIG** de Perú bajó 18 pbs en lo que va del mes y se ubicó en 152 pbs el 28 de octubre.

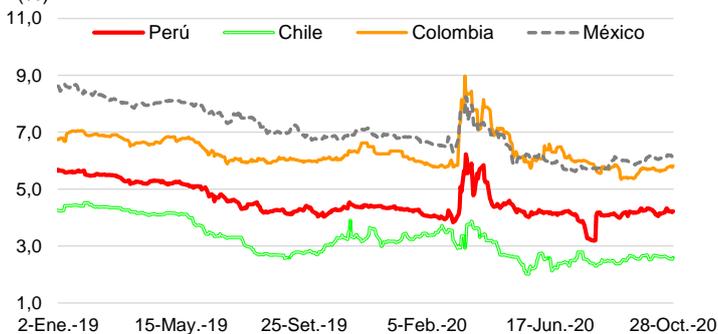
EMBIG



	Variación en pbs.			
	28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
Perú	152	7	-18	45
Chile	174	13	-9	31
Colombia	247	13	56	77
México	475	-8	-26	181

El rendimiento de los **bonos soberanos peruanos a 10 años** se mantiene como uno de los más bajos de la región.

Rendimiento bonos soberanos 10 años (%)



	Variación en pbs.			
	28 Oct.2020	21 Oct.2020	30 Set.2020	31 Dic.2019
Perú	4,2	-11	-11	-17
Chile	2,6	-1	-8	-57
Colombia	5,8	8	14	-52
México	6,2	1	5	-73

Rendimiento de los US Treasuries se ubicó en 0,77 por ciento

El rendimiento del **bono del Tesoro** norteamericano disminuyó 5 pbs a 0,77 por ciento entre el 21 y el 28 de octubre, luego que desaparecían las esperanzas de lograr un pronto acuerdo para un paquete de estímulos en Estados Unidos y por la preocupación de los inversionistas por el rápido aumento de casos de Covid.

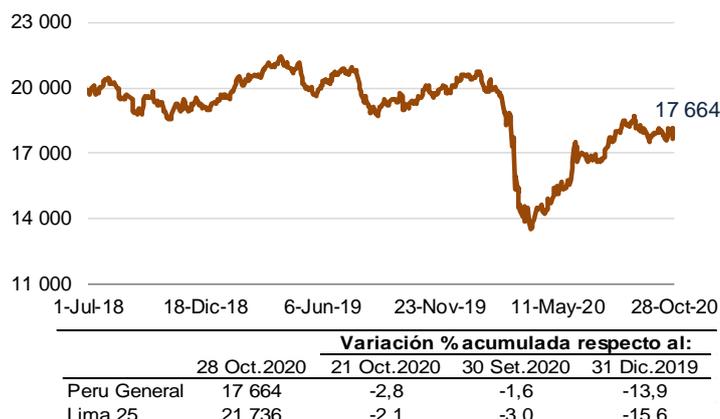
Tasa de Interés de Bono del Tesoro de EUA a 10 años (%)



ÍNDICES DE LA BOLSA DE VALORES DE LIMA

Entre el 21 y el 28 de octubre, el Índice **General** de la Bolsa de Valores de Lima (IGBVL-Perú General) se redujo 2,8 por ciento y el Índice **Selectivo** (ISBVL-Lima 25) lo hizo en 2,1 por ciento, en un entorno de caída de los precios de los metales.

Peru General de la BVL
(Base Dic.1991=100)



BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	22 Oct	23 Oct	26 Oct	27 Oct	28 Oct
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	25 098,5	27 246,6	26 158,1	25 661,0	26 583,9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. <u>Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)</u>					
Propuestas recibidas	28,3	111,0	190,2	190,0	200,0
Plazo de vencimiento	28,3	143,0	190,2	190,0	307,7
Tasas de interés: Mínima	89 d	66 d	29 d	28 d	90 d
Máxima	0,28	0,26	0,24	0,24	0,24
Promedio	0,28	0,27	0,25	0,25	0,27
Saldo	0,28	0,27	0,25	0,25	0,27
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Noviembre del 2020	<u>39 101,1</u>	<u>38 553,1</u>	<u>38 743,3</u>	<u>38 933,3</u>	<u>38 933,3</u>
Vencimiento de CD BCRP del 29 al 30 de Oct. del 2020					309,0
ii. <u>Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)</u>					0,0
Saldo	<u>5 958,5</u>	<u>5 758,5</u>	<u>5 758,5</u>	<u>5 758,5</u>	<u>5 758,5</u>
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 29 de Octubre del 2020					400,0
Vencimiento de Repo Valores del 29 al 30 de Oct. del 2020					400,0
iii. <u>Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)</u>					
Saldo	<u>357,1</u>	<u>357,1</u>	<u>357,1</u>	<u>357,1</u>	<u>360,1</u>
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 18 de Noviembre del 2020					100,0
iv. <u>Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)</u>					
Saldo adjudicado	<u>53 399,9</u>				
v. <u>Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)</u>					
Saldo adjudicado	<u>1 882,2</u>				
vi. <u>Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)</u>					
Propuestas recibidas	3 000,0 15 499,4	4 000,1 16 511,1	3 500,0 16 387,2	2 999,9 15 827,7	3 500,2 16 691,7
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 3 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d
Tasas de interés: Mínima	0,24 0,24	0,24 0,23	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 0,24
Máxima	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25
Promedio	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25
Saldo	<u>32 416,2</u>	<u>33 427,9</u>	<u>33 387,2</u>	<u>32 827,6</u>	<u>33 691,9</u>
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de Octubre del 2020					19 691,7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 al 30 de Oct. del 2020					23 691,8
vii. <u>Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)</u>					
Saldo	<u>2 500,1</u>	<u>2 500,1</u>	<u>2 000,0</u>	<u>2 000,0</u>	<u>2 000,0</u>
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 30 de Octubre del 2020					500,0
viii. <u>Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)</u>				<u>108,0 200,0</u>	<u>200,0</u>
Saldo	<u>6 410,0</u>	<u>6 410,0</u>	<u>6 410,0</u>	<u>6 718,0</u>	<u>6 918,0</u>
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Noviembre del 2020					300,0
ix. <u>Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)</u>					
Saldo	<u>5 695,0</u>				
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Febrero del 2021					500,0
x. <u>Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP</u>	299,9 17,4	300,0 528,3	300,1	171,0	299,9
Saldo	<u>5 174,6</u>	<u>6 002,9</u>	<u>6 303,0</u>	<u>6 474,0</u>	<u>6 773,9</u>
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Noviembre del 2020					236,6
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	185,2	109,2	58,5	24,6	9,6
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US\$)	-100,0	0,0	0,0	0,3	0,0
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,3	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)	100,0	0,0	0,0	0,0	0,0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	6 756,0	6 733,6	6 139,2	6 360,0	6 004,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0014%	0,0014%	0,0014%	0,0014%	0,0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0,50%	0,50%	0,50%	0,50%	0,50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	<u>5 344,1</u>	<u>5 512,2</u>	<u>5 269,6</u>	<u>5 221,8</u>	<u>4 789,0</u>
Tasa de interés	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 411,9	1 221,4	869,6	1 138,2	1 215,0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 026,8	8 955,8	8 763,9	8 712,0	8 662,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,4	4,4	4,3	4,3	4,2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 850,4	2 779,6	2 586,3	2 532,6	2 482,8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,4	1,4	1,3	1,2	1,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	<u>97,0</u>	<u>93,0</u>	<u>61,0</u>	<u>58,0</u>	<u>53,0</u>
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>0,0</u>	<u>2,0</u>	<u>27,0</u>
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	21 Oct	22 Oct	23 Oct	26 Oct	27 Oct
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	88,7	-114,5	19,5	-29,9	15,1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	81,0	-99,0	-150,5	-136,9	-53,7
a. <u>Mercado spot con el público</u>	<u>79,5</u>	<u>-110,7</u>	<u>-200,5</u>	<u>-152,9</u>	<u>-158,4</u>
i. Compras	274,5	243,1	177,6	157,6	188,8
ii. (-) Ventas	195,0	353,7	378,1	310,5	347,3
b. <u>Compras forward y swap al público (con v sin entrega)</u>	<u>-42,4</u>	<u>-214,9</u>	<u>20,3</u>	<u>-159,9</u>	<u>105,6</u>
i. Pactadas	127,1	180,3	197,1	301,6	299,2
ii. (-) Vencidas	169,4	395,2	176,8	461,5	193,6
c. <u>Ventas forward y swap al público (con v sin entrega)</u>	<u>142,4</u>	<u>-124,1</u>	<u>80,6</u>	<u>-184,1</u>	<u>84,1</u>
i. Pactadas	350,8	270,5	278,1	211,1	335,5
ii. (-) Vencidas	208,4	394,6	197,5	395,3	251,4
d. <u>Operaciones cambiarias interbancarias</u>					
i. Al contado	479,7	284,9	359,2	431,2	354,3
ii. A futuro	36,0	30,0	127,0	20,0	35,0
e. <u>Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega</u>	<u>57,1</u>	<u>11,0</u>	<u>73,1</u>	<u>-49,9</u>	<u>75,5</u>
i. Compras	207,1	392,5	196,5	392,7	248,0
ii. (-) Ventas	150,0	381,5	123,4	442,6	172,4
f. <u>Efecto de Opciones</u>	<u>-0,4</u>	<u>-12,7</u>	<u>0,5</u>	<u>-0,6</u>	<u>-0,1</u>
g. <u>Operaciones netas con otras instituciones financieras</u>	<u>176,2</u>	<u>88,1</u>	<u>227,5</u>	<u>83,0</u>	<u>134,5</u>
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,5984	3,6035	3,6031	3,6038	3,6079
(*) Datos preliminares					

Tipo de Cambio, Cotizaciones, Tasas de Interés e Índices Bursátiles

		Dic-18 (5)	Dic-19 (4)	30-Set (2)	21-Oct (1)	28-Oct (1)	Variaciones respecto a				
							Semana (1)/(2)	Mes (1)/(3)	Dic-19 (1)/(4)	Dic-18 (1)/(5)	
TIPOS DE CAMBIO											
AMÉRICA											
BRASIL	Real	3,880	4,019	5,611	5,607	5,746	2,48%	2,40%	42,96%	48,07%	
ARGENTINA	Peso	37,619	59,860	76,170	77,670	78,300	0,81%	2,80%	30,81%	108,14%	
MÉXICO	Peso	19,640	18,925	22,099	21,107	21,280	0,82%	-3,71%	12,44%	8,35%	
CHILE	Peso	693	752	785	783	773	-1,21%	-1,46%	2,90%	11,61%	
COLOMBIA	Peso	3 245	3 285	3 825	3 765	3 829	1,70%	0,08%	16,54%	17,98%	
EUROPA											
EURO	Euro	1,147	1,121	1,172	1,186	1,174	-0,99%	0,19%	4,76%	2,40%	
SUIZA	FZ por US\$	0,981	0,968	0,921	0,905	0,910	0,55%	-1,13%	-5,94%	-7,24%	
INGLATERRA	Libra	1,276	1,326	1,292	1,314	1,298	-1,17%	0,50%	-2,10%	1,76%	
TURQUÍA	Lira	5,288	5,948	7,716	7,809	8,256	5,73%	7,00%	38,80%	56,13%	
ASIA Y OCEANÍA											
JAPÓN	Yen	109,560	108,610	105,450	104,560	104,290	-0,26%	-1,10%	-3,98%	-4,81%	
COREA	Won	1 113,30	1 154,07	1 164,65	1 133,24	1 134,93	0,15%	-2,55%	-1,66%	1,94%	
INDIA	Rupia	69,56	71,35	73,56	73,59	74,18	0,80%	0,84%	3,97%	6,64%	
CHINA	Yuan	6,876	6,962	6,790	6,650	6,728	1,17%	-0,91%	-3,36%	-2,15%	
AUSTRALIA	US\$ por AUD	0,705	0,702	0,716	0,712	0,704	-1,07%	-1,69%	0,27%	-0,13%	
COTIZACIONES											
ORO	LBMA (\$/Oz.T.)	1 281,65	1 523,00	1 886,90	1 924,15	1 869,95	-2,82%	-0,90%	22,78%	45,90%	
PLATA	H & H (\$/Oz.T.)	15,51	17,92	23,81	25,07	23,51	-6,21%	-1,26%	31,21%	51,57%	
COBRE	LME (US\$/lb.)	2,70	2,79	3,02	3,17	3,05	-3,55%	0,93%	9,45%	13,13%	
ZINC	LME (US\$/lb.)	1,14	1,03	1,08	1,16	1,14	-1,29%	5,52%	10,54%	0,05%	
PLOMO	LME (US\$/lb.)	0,91	0,87	0,82	0,81	0,81	-0,67%	-0,97%	-6,74%	-11,09%	
PETRÓLEO	West Texas (\$/B)	45,15	61,14	40,05	39,88	37,27	-6,54%	-6,94%	-39,04%	-17,45%	
TRIGO SPOT **	Kansas (\$/TM)	220,09	213,85	191,07	213,11	213,11	0,00%	11,54%	-0,34%	-3,17%	
MAÍZ SPOT **	Chicago (\$/TM)	131,49	144,09	136,21	155,11	155,11	0,00%	13,87%	7,65%	17,96%	
ACEITE SOYA	Chicago (\$/TM)	604,508	774,925	746,926	753,981	758,831	0,64%	1,59%	-2,08%	25,53%	
TASAS DE INTERÉS											
Bonos del Tesoro Americano (3 meses)		2,36	1,55	0,09	0,09	0,09	0,53	0,25	-145,50	-226,70	
Bonos del Tesoro Americano (2 años)		2,49	1,57	0,13	0,15	0,15	0,18	2,20	-142,20	-234,10	
Bonos del Tesoro Americano (10 años)		2,69	1,92	0,69	0,82	0,77	-5,10	8,80	-114,60	-191,20	
ÍNDICES DE BOLSA											
AMÉRICA											
E. E. U. U.	Dow Jones	23 327	28 538	27 782	28 211	26 520	-5,99%	-4,54%	-7,07%	13,69%	
	Nasdaq Comp.	6 635	8 973	11 168	11 485	11 005	-4,18%	-1,46%	22,65%	65,85%	
BRASIL	Bovespa	87 887	115 645	94 603	100 552	95 369	-5,16%	0,81%	-17,53%	8,51%	
ARGENTINA	Merval	30 293	41 671	41 261	50 089	43 533	-13,09%	5,51%	4,47%	43,71%	
MÉXICO	IPC	41 640	43 541	37 459	38 669	37 394	-3,30%	-0,17%	-14,12%	-10,20%	
CHILE	IPSA	5 105	4 670	3 637	3 783	3 629	-4,05%	-0,21%	-22,28%	-28,91%	
COLOMBIA	COLCAP	1 326	1 662	1 172	1 178	1 120	-4,89%	-4,40%	-32,61%	-15,50%	
PERÚ	Ind. Gral.	19 350	20 526	17 949	18 165	17 664	-2,76%	-1,59%	-13,94%	-8,71%	
PERÚ	Ind. Selectivo	26 508	25 753	22 409	22 192	21 736	-2,05%	-3,00%	-15,60%	-18,00%	
EUROPA											
ALEMANIA	DAX	10 559	13 249	12 761	12 558	11 561	-7,94%	-9,41%	-12,74%	9,49%	
FRANCIA	CAC 40	4 731	5 978	4 803	4 854	4 571	-5,83%	-4,84%	-23,54%	-3,37%	
REINO UNIDO	FTSE 100	6 728	7 542	5 866	5 777	5 583	-3,35%	-4,83%	-25,98%	-17,02%	
TURQUÍA	XU100	91 270	114 425	1 145	1 212	1 127	-6,98%	-1,59%	-99,02%	-98,77%	
RUSIA	RTS	1 066	1 549	1 179	1 143	1 078	-5,70%	-8,50%	-30,38%	1,14%	
ASIA											
JAPÓN	Nikkei 225	20 015	23 657	23 185	23 639	23 419	-0,93%	1,01%	-1,01%	17,01%	
HONG KONG	Hang Seng	25 846	28 190	23 459	24 754	24 709	-0,18%	5,33%	-12,35%	-4,40%	
SINGAPUR	Straits Times	3 069	3 223	2 467	2 526	2 483	-1,67%	0,68%	-22,94%	-19,07%	
COREA	Kospi	2 041	2 198	2 328	2 371	2 345	-1,08%	0,75%	6,72%	14,91%	
INDONESIA	Jakarta Comp.	6 194	6 300	4 870	5 096	5 128	0,62%	5,30%	-18,59%	-17,21%	
MALASIA	Klci	1 691	1 589	1 505	1 492	1 495	0,19%	-0,64%	-5,89%	-11,56%	
TAILANDIA	SET	1 564	1 580	1 237	1 216	1 208	-0,70%	-2,35%	-23,54%	-22,76%	
INDIA	Nifty 50	10 863	12 168	11 248	11 938	11 730	-1,74%	4,29%	-3,61%	7,98%	
CHINA	Shanghai Comp.	2 494	3 050	3 218	3 325	3 269	-1,68%	1,59%	7,18%	31,09%	

Datos correspondientes a fin de periodo

(*) Desde el día 11 de agosto de 2009, la cotización corresponde al Azúcar Contrato 16 (el Contrato 14 dejó de negociarse el día 10 de agosto de 2009). El contrato 16 tiene las mismas características que el Contrato 14.

(**) Desde el día 18 de septiembre del 2020, los datos corresponden promedio de la semana.

Fuente: Reuters, JPMorgan

