

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	14 Oct 19	15 Oct 19	16 Oct 19	17 Oct 19	18 Oct 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4 626,7	4 161,9	3 438,6	3 288,0	2 203,7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
ii. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0	199,9	200,0	200,0	30,0
Plazo de vencimiento	190,0	973,5	778,0	803,0	639,0
Tasas de interés	171,4	354,4	171,4	357,4	175,4
Máxima	2,21	2,28	2,21	2,26	2,19
Promedio	2,21	2,27	2,21	2,29	2,21
Saldo	29 875,1	29 875,1	29 375,1	29 420,1	29 465,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de noviembre de 2019	1 745,0	1 745,0	1 745,0	1 745,0	1 745,0
Vencimiento de CD BCRP del 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 300,0	3 300,0	3 300,0	3 300,0	3 300,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 24 de octubre de 2019	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Repo Valores del 21 al 25 de octubre del 2019	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 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	1 300,1	1 300,1	703,2	900,0	1 072,8
Plazo de vencimiento	1 328,1	1 328,1	703,2	900,0	1 072,8
Tasas de interés	1,6	2,0	1,6	2,4	2,0
Máxima	2,50	2,50	2,50	2,50	2,45
Promedio	2,42	2,46	2,40	2,46	2,38
Saldo	1 300,1	1 300,1	703,2	900,0	1 072,8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de octubre de 2019	1 300,1	1 300,1	703,2	900,0	1 072,8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación de Papeles del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,1
Próximo vencimiento de Colocación de Papeles el 24 de octubre de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Colocación de Papeles del 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables 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 el 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 21 al 25 de octubre 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					
Promedio					
Saldo	11 950,1	11 950,1	11 950,1	11 950,1	11 950,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 28 de octubre de 2019	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Repo Regular del 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepcional)					
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 Excepcional el 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Excepcional del 21 al 25 de octubre 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					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Sustitución del 21 al 25 de octubre 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					
Promedio					
Saldo	900,0	900,0	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de SC Venta el 5 de noviembre de 2019	900,0	900,0	900,0	900,0	900,0
Vencimiento de SC - Venta del 21 al 25 de octubre del 2019	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 el 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 21 al 25 de octubre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en el Mercado de Neocesión 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	2,1	4,9	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					

	2 926.7	3 068.7	2 958.8	2 185.2	1 963.7
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones					
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.0075%	0.0075%	0.0075%	0.0075%	0.0085%
Comisión tasa efectiva diaria					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	3.05%	3.05%	3.05%	3.05%	3.05%
Tasa de interés					
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	140.0	175.0	175.0	467.4	193.2
Tasa de interés	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%
d. Deudados Overnight en moneda nacional	2 786.7	3 888.2	2 333.6	1 717.9	1 776.6
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones					
i. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/)) (*)	9 336.9	9 257.0	9 228.4	9 102.6	8 965.6
ii. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	6.0	6.0	5.8	5.8	5.7
c. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	3 894.3	3 898.1	3 777.8	3 650.4	3 508.8
d. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	2.5	2.4	2.2	2.3	2.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	475.0	422.0	317.1	591.5	1 257.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,502,502.50	2,502,502.50	2,502,502.50	2,502,502.50	2,502,502.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	21.0	21.0	53.0	53.0	25.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,002,002.00	2,002,002.00	2,002,002.00	2,002,002.00	2,002,002.00
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\$)	11 Octubre 19	14 Octubre 19	15 Octubre 19	16 Octubre 19	17 Octubre 19
Pago de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-253.8	61.7	-69.1	103.1	47.8
Pago de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-60.4	69.9	86.0	57.1	-128.3
ii. Mercado spot con el público	-77.1	3.4	87.5	27.5	-114.0
i. Compras	414.1	214.2	328.6	268.6	475.5
ii. Ventas	491.3	210.8	241.0	240.1	589.5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-68.2	-41.4	42.8	50.0	144.3
i. Pactadas	-62.1	66.1	212.0	179.6	497.9
ii. (+) Ventadas	230.3	120.5	169.2	129.6	353.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-68.5	-33.7	40.9	4.4	-32.8
i. Pactadas	283.9	20.4	454.9	144.0	504.9
ii. (+) Ventadas	352.4	54.1	364.8	139.6	537.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	339.6	230.5	328.3	319.4	637.5
ii. A futuro	69.0	10.0	62.0	62.0	39.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	142.6	-4.6	185.2	34.9	171.0
i. Compras	319.1	52.3	325.2	137.6	487.0
ii. (+) Ventas	176.5	66.9	141.0	102.7	316.0
f. Efecto de Opciones	1.2	-0.5	-1.0	0.4	-1.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-180.7	-4.3	-167.9	-5.3	-1.2
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
ii. Tasa de interés					
Nota: Totales de mercado interbancario promedio (Fuente: Datos)	3,356.0	3,354.0	3,370.0	3,366.2	3,354.6
(*) Tasa preferencial					