

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	21 Oct 19	22 Oct 19	23 Oct 19	24 Oct 19	25 Oct 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	967,4	803,4	696,3	115,0	996,8
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	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	130,5		110,0	96,0	
Tasas de interés	159 d		531 d	548 d	
Máxima	2,19		2,35	2,25	
Promedio	2,23		2,37	2,29	
Saldo	2,21		2,36	2,27	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de noviembre de 2019	29 495,1	29 495,1	29 540,1	29 585,1	29 585,1
Vencimiento de CD BCRP del 28 octubre al 1 de noviembre del 2019	1 745,0	1 745,0	1 745,0	1 745,0	1 745,0
Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500,0	600,0	700,0	200,0	400,0
Plazo de vencimiento	1000,0	1200,0	1200,0	600,0	400,0
Tasas de interés	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Máxima	3,08	2,85	2,97	3,28	3,11
Promedio	3,08	3,05	3,05	3,30	3,11
Saldo	3,08	3,05	3,05	3,28	3,11
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 28 de octubre de 2019	3 800,0	3 800,0	4 000,0	3 700,0	3 770,0
Vencimiento de Repo Valores del 28 octubre al 1 de noviembre del 2019	500,0	600,0	900,0	400,0	470,0
700,0	800,0	900,0	400,0	470,0	
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 28 octubre al 1 de noviembre 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	1300,1		
Propuestas recibidas	1328,1		1328,1		
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d		
Tasas de interés	2,0	2,0	2,0		
Máxima	2,50	2,50	2,50		
Promedio	2,42	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	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 octubre al 1 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,1	4 100,1	4 100,1	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP al 31 de octubre de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 28 octubre al 1 de noviembre del 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 28 octubre al 1 de noviembre 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 del 28 octubre al 1 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	200,0	200,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (E expansión)					
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 Expansión	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Expansión del 28 octubre al 1 de noviembre 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Sustitución del 28 octubre al 1 de noviembre 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	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de noviembre de 2019	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 28 octubre al 1 de noviembre 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 28 octubre al 1 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación 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	0,0	0,0	0,0	0,5	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					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 437,4	1 403,4	1 366,3	1 185,0	1 466,8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0085%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnights en moneda nacional	148,0	104,9	242,0	307,0	772,6
Tasa de interés	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1 289,4	1 289,5	1 243,3	878,9	694,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 718,1	8 718,1	8 530,9	8 442,4	8 350,2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,6	5,6	5,4	5,4	5,3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 251,6	3 251,6	3 053,4	2 975,4	2 981,6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,1	2,1	2,0	1,9	1,8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	947,7	530,3	537,7	851,5	555,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.502.502/2.50	2.502.502/2.50	2.502.502/2.50	2.502.652/2.58	2.502.552/2.51
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				200,0/2,00	
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					2.002,00/2,00
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	18 Octubre 19	21 Octubre 19	22 Octubre 19	23 Octubre 19	24 Octubre 19
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	117,4	-8,4	-27,8	-216,3	38,3
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	230,6	0,6	-22,8	-12,5	-55,2
a. Mercado spot con el público	212,2	91,8	10,0	35,9	-0,7
i. Compras	563,7	318,6	259,6	250,5	356,1
ii. Ventas	346,6	226,8	249,6	214,6	356,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	3,4	-75,7	41,2	-370,0	-236,0
i. Facturas	137,9	174,7	123,1	183,0	172,2
ii. (-) Ventas	134,5	250,4	81,9	553,0	408,2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	119,5	-66,6	45,0	-165,3	-338,6
i. Facturas	378,4	419,9	295,7	100,5	330,2
ii. (-) Ventas	257,0	486,6	250,7	265,8	669,8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	534,0	412,5	451,0	429,6	492,0
ii. A futuro	122,0	152,0	152,0	25,0	21,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	135,7	141,6	150,6	-284,8	221,8
i. Compras	218,6	318,0	209,0	265,0	573,6
ii. (-) Ventas	178,4	176,4	158,4	549,7	351,8
f. Efecto de Opciones	2,8	0,0	-1,2	1,0	-0,2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,2		-14,7	-50,9	-24,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.3437	3.3459	3.3407	3.3456	3.3499
i. Datos preliminares					