

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	28 Oct 19	29 Oct 19	30 Oct 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 279,9	1 894,7	326,2
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	30,0		30,0
Plazo de vencimiento	114,0		43,0
Tasas de inter Mínima	192 d		552 d
Máxima	2,19		2,36
Promedio	2,25		2,41
Saldo	2,22		2,39
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de noviembre de 2019	29 615,1	29 615,1	29 645,1
Vencimiento de CD BCRP del 4 al 8 de noviembre del 2019	1 745,0		1 745,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	0,0		3 670,0
Propuestas recibidas			500,0
Plazo de vencimiento			960,0
Tasas de inter Mínima			5 d
Máxima			2,96
Promedio			3,30
Saldo	3 300,0	3 300,0	3 800,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de noviembre de 2019	200,0		700,0
Vencimiento de Repo Valores del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		700,0
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			
Propuestas recibidas		500,0	
Plazo de vencimiento		547,8	
Tasas de inter Mínima		1 d	
Máxima		2,0	
Promedio		2,50	
Saldo	0,0	2,36	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	500,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas			500,0
Plazo de vencimiento			1020,5
Tasas de inter Mínima			366 d
Máxima			3,98
Promedio			3,51
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de noviembre de 2019	500,0		500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 4 al 8 de noviembre del 2019	500,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	11 750,1	11 750,1	11 750,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 4 de noviembre de 2019	200,0		200,0
Vencimiento de REPO del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		200,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Expansión del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	300,0	300,0	300,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de noviembre de 2019	300,0		300,0
Vencimiento de SC - Venta del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		300,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de inter Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 4 al 8 de noviembre del 2019	0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR	0,0	0,0	0,0
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	2,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	2,0	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
ii. Compras de BTP			

3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 249,9	1 394,7	1 326,2
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps). Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0075%	0,0081%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) Tasa de interés	3,05%	3,05%	3,05%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional Tasa de interés	307,2 1,25%	565,4 1,25%	241,0 1,25%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional Tasa de interés	307,2 1,25%	565,4 1,25%	241,0 1,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	942,7	829,3	1 085,2
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) ^(*)	8 350,2	8 050,2	8 003,5
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ^(*)	5,3	5,1	5,1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 881,6	2 586,8	2 528,2
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) ^(*)	1,8	1,7	1,6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1 098,0 2,50/2,50/2,50	773,0 2,50/2,50/2,50	814,1 2,50/2,50/2,50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$) Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	25,0 2,00/2,00/2,00	31,0 2,00/2,00/2,00	20,0 2,00/2,00/2,00
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV Plazo 6 meses (monto / tasa promedio) Plazo 12 meses (monto / tasa promedio) Plazo 2 años (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	25 Octubre 19	28 Octubre 19	29 Octubre 19
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	73,6	-96,4	130,6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-35,4	-148,8	-125,5
a. Mercado spot con el público	-9,1	-251,4	-121,2
i. Compras	299,0	330,1	305,6
ii (-) Ventas	307,1	591,5	426,8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	230,4	-10,1	-462,1
i. Pactadas	320,8	459,5	315,3
ii (-) Vencidas	90,4	469,6	777,4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	121,8	-61,4	-718,2
i. Pactadas	298,9	251,2	365,5
ii (-) Vencidas	177,1	312,6	1083,7
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	435,7	642,0	546,5
ii. A futuro	55,0	70,0	30,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	93,3	-48,0	293,9
i. Compras	139,6	303,4	1027,0
ii (-) Ventas	46,4	351,4	733,6
f. Efecto de Opciones	0,4	1,1	-0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-33,9	3,6	8,7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3471	3,3316	3,3379
(*) Datos preliminares			