

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	4 Nov 19	5 Nov 19	6 Nov 19	7 Nov 19	8 Nov 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	2 841,7	3 473,5	3 909,9	6 200,7	5 740,1
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)	30,0		30,0	30,0	300,0
Propuestas recibidas	156,2		74,0	257,5	842,0
Plazo de vencimiento	185 d		545 d	362 d	361 d
Tasas de interés	2,19		2,40	2,25	2,25
Máxima	2,22		2,40	2,25	2,25
Promedio	2,20		2,40	2,25	2,21
Saldo	27 945,1	27 945,1	27 975,1	26 545,1	27 103,1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de noviembre de 2019	1 925,0		1 925,0		175,1
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de noviembre del 2019	1 925,0		1 925,0		175,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2100,0	1500,0	1200,0		
Propuestas recibidas	4600,0	3500,0	2400,0		
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d		
Tasas de interés	2,90	2,96	2,50		
Máxima	3,09	2,97	2,55		
Promedio	3,0	2,97	2,51		
Saldo	5 200,0	4 600,0	4 300,0	3 100,0	3 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de noviembre de 2019	2 100,0		1 200,0		200,0
Vencimiento de Repo Valores del 11 al 15 de noviembre del 2019	2 100,0		1 200,0		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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas		1 800,1	1 300,1	800,1	500,0
Plazo de vencimiento		1328,1	1328,1	1971,2	1440,0
Tasas de interés		1,6	1,6	1,6	3,6
Máxima		2,0	2,0	2,0	1,50
Promedio		2,50	2,42	2,42	2,12
Saldo	0,0	0,0	0,0	800,1	500,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de noviembre de 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	500,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	500,0
v. Subasta de Colocación de Papeles del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Colocación de Papeles del Tesoro Público el 20 de noviembre de 2019	500,0		500,0		500,0
Vencimiento de Colocación de Papeles del Tesoro Público del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustados 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 11 al 15 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	11 550,1	11 550,1	11 550,1	11 550,1	11 550,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 25 de noviembre de 2019	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de Repo del 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepción)					
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 Excepción	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Excepción del 11 al 15 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 11 al 15 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	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC Venta	300,0		0,0		0,0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de noviembre del 2019	300,0		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 11 al 15 de noviembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en el Mercado de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
i. Ventas (millones de US\$)					
ii. Ventas (millones de US\$)					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	2,8	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	2,8	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					

	4 911,7	4 973,5	5 079,9	5 070,6	4 748,1
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 911,7	4 973,5	5 079,9	5 070,6	4 748,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones:					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0081%	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0075%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3,05%	3,05%	3,05%	3,05%	2,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	8,0	8,0	8,0	10,0	20,0
d. Depósitos Overnight en moneda nacional					
Tasa de interés	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%	1,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 900,7	4 865,5	5 071,9	5 060,6	4 729,1
1 Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/)) (*)	7 987,5	8 596,3	8 596,3	8 503,6	8 120,6
2 Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	5,1	5,4	5,4	5,6	5,8
c Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	2 489,9	3 015,0	3 015,0	3 322,5	3 539,7
d Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% de TOSE)) (*)	1,8	1,9	1,9	2,1	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	878,0	713,6	878,4	834,8	1 482,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,502/2,502/2,50	2,502/2,502/2,50	2,502/2,502/2,50	2,502/2,502/2,50	2,252/2,302/2,28
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)		34,0	61,0	26,0	91,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio		1,751/1,751/1,75	1,751/1,751/1,75	1,751/1,751/1,75	1,751/1,751/1,75
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\$)	31 Octubre 19	04 Noviembre 19	05 Noviembre 19	06 Noviembre 19	07 Noviembre 19
Pago de la posición contable = a + b + c + e + f + g	11,0	-1,2	17,3	42,0	26,3
Pago de la posición contable = a + b + c + e + f + g	4,9	-2,6	-70,6	20,8	29,6
a. Mercado spot con el público	1,6	-1,0	72,7	-19,8	26,9
i. Compras	82,7	349,5	269,4	258,5	323,4
ii. Ventas	81,0	370,6	342,1	278,2	296,7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	36,9	-12,0	117,7	255,1	13,8
i. Pactadas	-20,5	193,7	372,4	370,2	433,6
ii. (+) Vencidas	5,1	205,8	254,8	115,1	419,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	30,8	-13,7	56,6	233,9	8,9
i. Pactadas	32,3	318,5	301,3	303,3	793,5
ii. (+) Vencidas	1,5	332,3	359,9	69,4	784,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	0,0	555,0	659,4	998,9	710,3
ii. A futuro	0,0	34,0	40,0	194,7	84,5
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	1,7	125,6	111,3	15,0	337,4
i. Compras	0,0	314,4	331,4	69,0	752,5
ii. (+) Ventas	1,7	180,8	220,0	74,0	415,0
f. Efecto de Opciones	0,0	-0,2	0,3	0,1	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	1,5	-8,6	-92,8	-0,2	-1,8
i. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Total de mercado interbancario promedio (Fuente: Datoce)	3,3486	3,3486	3,3381	3,3402	3,3489
(*) Tasa preferencial					