

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	06 Ene 20	07 Ene 20	08 Ene 20	09 Ene 20	10 Ene 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 586,6	3 896,8	4 572,4	4 866,9	4 261,3
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	30,0	30,0
Plazo de vencimiento	228,6	283,7	220,0	120,5	102,0
Tasas de interés	175,4	364,4	727,4	982,4	1089,4
Máxima	1,99	1,99	2,16	2,35	2,10
Promedio	2,0	2,03	2,22	2,39	2,04
Saldo	28 854,5	26 574,5	28 654,5	27 048,5	27 264,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de febrero de 2020	325,0	1 407,0	1 407,0	1 407,0	1 407,0
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de enero del 2020	800,0	300,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	800,0	300,0			
Plazo de vencimiento	1,4	1,4			
Tasas de interés	2,30	2,25			
Máxima	2,30	2,25			
Promedio	4 650,0	4 150,0			
Saldo	800,0	300,0	3 850,0	3 850,0	3 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de marzo de 2020	800,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 13 al 17 de enero del 2020	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 13 al 17 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de enero de 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Colocación de Papeles del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Colocación de Papeles el 23 de enero de 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Colocación de Papeles el 13 al 17 de enero del 2020	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	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Colocación de Papeles el 23 de enero de 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Colocación de Papeles del 13 al 17 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Rescatables 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 13 al 17 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Rescatar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de febrero de 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Repo del 13 al 17 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansión)					
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 Exansión	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Exansión del 13 al 17 de enero del 2020	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 13 al 17 de enero del 2020	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 13 de enero de 2020	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de enero del 2020	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 13 al 17 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Compras con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
v. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR v BTP					
i. Compras de CD BCRP - 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	4 358,6	4 166,8	4 542,4	4 136,9	3 611,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0076%	0,0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%
c. Crédito por revalorización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	0,0	110,6	149,3	40,0	130,0
d. Depósitos Overnigth en moneda nacional					
Tasa de interés	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 358,6	4 056,2	4 393,1	4 096,9	3 481,3
a. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	9 712,7	9 742,1	9 703,6	9 701,0	9 701,0
b. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	6,0	6,0	6,0	6,0	6,0
c. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (millones de S/))	3 977,5	4 007,5	3 975,8	4 059,6	4 059,6
d. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado (% del TOSE)) (*)	2,5	2,5	2,5	2,5	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	873,1	1 100,5	1 363,9	1 348,5	1 296,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	33,0	25,0	15,0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total Mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR v CDV	1.751/1.751/1,75	1.751/1.751/1,75	1.751/1.751/1,75		
Plazo 0 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\$)	03 Enero 20	06 Enero 20	07 Enero 20	08 Enero 20	09 Enero 20
Flujo de la posición (global) = a + b1 - c1 + e + f + g	-70,3	60,3	-61,4	-61,4	175,1
Flujo de la posición con el público = a + b1 - c1 + e + f + g	-120,9	-36,8	-117,9	-36,4	63,9
a. Mercado spot con el público	-112,1	-24,7	-66,1	-28,0	41,2
i. Compras	24,7	30,4	45,1	30,7	35,7
ii. Ventas	-39,5	-32,1	-35,4	-35,1	-31,5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-5,4	6,1	-4,4	-1,6	-25,8
i. Pactivas	-137,3	22,9	169,8	212,9	271,0
ii. (i) Ventas	142,8	15,4	219,2	165,9	343,8
iii. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-56,9	149,4	-69,8	169,8	-392,1
i. Pactivas	315,9	374,4	367,3	262,9	447,3
ii. (i) Ventas	271,8	224,9	207,5	124,2	839,4
c. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	725,7	606,3	1 189,4	1 081,0	1 093,0
ii. Al plazo	51,0	100,0	100,0	100,0	48,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	231,2	116,0	29,0	31,8	318,3
f. Compras	228,6	232,2	207,9	123,5	81,3
g. Ventas	6,6	-116,2	-178,4	-191,7	-494,0
h. Efectos de Comercio	0,2	-6,8	-0,1	-0,1	-8,9
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-11,0	-6,8	-21,1	-2,5	-6,2
g. Crédito por revalorización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tasa de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3108	3,3225	3,3267	3,3187	3,3201
(*) Datos preliminares					