

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Ene 20	28 Ene 20	29 Ene 20	30 Ene 20	31 Ene 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	738,7	1 006,0	1 143,4	1 483,6	1 070,3
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	
Plazo de vencimiento	150,0	150,0	150,0	150,0	
Tasas de interés	192,4	192,4	192,4	192,4	
Máxima	2,07	2,09	2,07	2,25	
Promedio	2,11	2,14	2,11	2,33	
Saldo	2,10	2,10	2,12	2,29	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de febrero de 2020	1 407,0	1 407,0	1 407,0	1 407,0	28 579,4
Vencimiento de CD BCRP del 3 al 7 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	1 407,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	500,0	200,0	0,0	0,0	1 200,0
Plazo de vencimiento	500,0	400,0	0,0	0,0	1 450,0
Tasas de interés	1,4	1,4			3,4
Máxima	2,71	2,75			3,0
Promedio	2,71	2,75			3,35
Saldo	4 350,0	4 050,0	3 850,0	3 850,0	3,07
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de febrero de 2020	500,0	200,0	300,0	300,0	6 050,0
Vencimiento de Repo Valores del 3 al 7 de febrero del 2020	500,0	200,0	0,0	0,0	1 200,0
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 3 al 7 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. 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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 3 al 7 de febrero 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 del Tesoro Público	200,0	200,0	200,0	200,0	200,0
Vencimiento de Colocación de Papeles del Tesoro Público del 3 al 7 de febrero del 2020	0,0	0,0	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 3 al 7 de febrero 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 3 al 7 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	800,0	800,0
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 3 al 7 de febrero 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 3 al 7 de febrero 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	300,0	300,0	300,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de febrero de 2020	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 3 al 7 de febrero 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 3 al 7 de febrero del 2020	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
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
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
c. 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	1 268,7	1 176,0	1 113,4	1 483,6	2 270,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (forward)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0075%	0,0084%
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 reposición monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	1,85	1,85	1,85	1,85	1,85
Depósitos Overnigth en moneda nacional	198,5	116,0	151,0	676,3	137,1
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	1 010,2	1 066,0	862,4	777,3	2 133,2
a. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado millones de S/)	8 455,3	8 175,9	8 302,0	8 302,0	8 305,4
b. Fondos de encaje en moneda nacional (promedio acumulado % del TOSE) (*)	5,2	5,1	5,1	5,1	5,1
c. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado millones de S/)	2 731,3	2 659,9	2 606,5	2 606,5	2 548,4
d. Cuenta corriente moneda nacional (promedio acumulado % del TOSE) (*)	1,7	1,6	1,6	1,6	1,6
6. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
8. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
9. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
10. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
11. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
12. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
13. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
14. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
15. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
16. Mercado Interbancario y Mercado Secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional					
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
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 v CDV					