

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	03 Feb 20	04 Feb 20	05 Feb 20	06 Feb 20	07 Feb 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	966,5	2 948,6	3 146,4	4 298,3	4 478,9
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias asociadas 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	148,0	174,0	180,0	112,0	
Tasas de interés	195,4	366,4	696,4	1162,4	
Mínima	2,07	2,09	2,15	2,25	
Máxima	2,11	2,12	2,17	2,29	
Promedio	2,08	2,11	2,16	2,28	
Saldo	28 626,4	27 292,4	27 322,4	25 862,4	25 862,4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de marzo de 2020	1 407,0		1 500,0		1 757,9
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de febrero del 2020	2 937,0		1 500,0		0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1000,0	1195,0	1300,0	1200,0	
Plazo de vencimiento	2250,0	1195,0	2300,0	2000,0	
Tasas de interés	1,4	1,4	1,4	1,4	
Mínima	2,50	2,25	2,58	2,28	
Máxima	2,80	2,57	2,70	2,60	
Promedio	2,68	2,29	2,64	2,51	
Saldo	8 045,0	5 160,0	5 650,0	3 850,0	3 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de marzo de 2020	2 195,0		1 200,0		300,0
Vencimiento de Repo Valores del 10 al 14 de febrero del 2020	2 195,0		1 200,0		0,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CULD BCRP el 10 al 14 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CULD BCRP del 10 al 14 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					
Mínima					
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 10 al 14 de febrero del 2020	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					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de marzo de 2020	200,0		200,0		200,0
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de febrero del 2020	0,0		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
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 10 al 14 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reouar)					
Propuestas recibidas		300,0			
Plazo de vencimiento	1630,0	1295,0			
Tasas de interés	366,4	366,4			
Mínima	2,57	2,81			
Máxima	3,80	2,85			
Promedio	2,83	2,82			
Saldo	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1	11 050,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de febrero de 2020	300,0		300,0		800,0
Vencimiento de Repo del 10 al 14 de febrero del 2020	300,0		0,0		0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Ercanar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Exarcan	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Exarcan del 10 al 14 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Substitucion)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Substitucion	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Substitucion del 10 al 14 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					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	600,0	600,0	600,0	600,0	600,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 10 de febrero de 2020	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de SC - Venta del 10 al 14 de febrero del 2020	0,0		0,0		300,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
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 10 al 14 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\$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	15,2	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	15,2	0,0	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					
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	3 631,5	4 418,6	4 314,4	4 298,3	4 478,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comisión temporal de mercado extranjera (Ivovar)	0,0075%	0,0076%	0,0075%	0,0075%	0,0076%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
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	3 631,5	4 418,6	4 314,4	4 298,3	4 478,9
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 266,0	8 993,9	9 264,9	9 370,0	9 481,1
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,1	5,4	5,6	5,7	5,8
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 485,3	3 079,1	3 347,0	3 483,5	3 595,6
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,5	1,8	1,9	2,1	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	859,0	1 057,9	1 262,5	1 026,6	1 263,2
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\$)	1,0				
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP - CDBCRP-NR y CDV	1 751,75/1,75				
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\$)	31 Enero 20	03 Febrero 20	04 Febrero 20	05 Febrero 20	06 Febrero 20
Fila de la posición (dólar) = a + b1 - c1 + e + f + g	66,8	34,4	189,7	129,6	80,0
Fila de la posición (euro) = a + b1 - c1 + e + f + g	49,9	5,3	19,8	100,6	83,4
a. Mercado spot con el público	26,5	19,2	122,2	86,6	134,7
i. Compras	46,3	34,2	286	33,9	426,4
ii. Ventas	437,2	329,8	420,4	420,4	291,7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	38,9	129,1	37	109	105,3
i. Periodos	280,1	244,2	116,5	235,6	264,6
ii. Ventas	191,4	115,1	115,9	115,9	370,1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	72,1	82,0	23,7	92,3	92,3
i. Periodos	247,1	231,1	214,8	214,8	636,0
ii. Ventas	275,6	319,1	314,5	191,1	729,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	747,6	1070,4	725,5	1062,3	967,2
ii. Al plazo	386,4	97,8	58,3	27,9	133,1
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	104,0	208,5	163,2	63,1	308,2
f. Compras	224,2	271,4	213,5	196,7	865,3
g. Ventas	130,3	103,7	150,3	133,6	357,1
h. Efectos de Depósitos	94	103	0,2	89	9,7
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	13,2	-16,3	-15,8	11,1	-1,2
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,3770	3,3737	3,3695	3,3589	3,3736