

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	10 Feb 20	11 Feb 20	12 Feb 20	13 Feb 20	14 Feb 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	5 177,0	8 421,3	8 771,0	8 808,2	7 559,3
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	100,0	200,0	30,0	200,0
Plazo de vencimiento	229,5	343,0	599,0	185,0	642,0
Tasas de interés	179,4	360,4	359,4	159,0	386,4
Mínima	2,04	2,08	2,01	2,08	2,08
Máxima	2,08	2,12	2,09	2,28	2,09
Promedio	2,07	2,10	2,09	2,27	2,08
Saldo	29 253,7	26 777,7	26 777,7	27 781,7	29 330,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de marzo de 2020	1 757,9	1 757,9	1 757,9	1 757,9	1 757,9
Vencimiento de CD BCRP del 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3 850,0	3 850,0	3 850,0	3 850,0	3 850,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 6 de marzo de 2020	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo Valores del 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	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 CCLD BCRP el 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CCLD BCRP del 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	700,0	100,0	2124,4	1500,0	3000,0
Plazo de vencimiento	1273,5	100,0	2174,4	1814,2	3000,3
Tasas de interés	1,4	1,4	1,5	1,4	1,4
Mínima	1,40	1,40	1,75	1,85	2,12
Máxima	2,14	2,25	2,25	2,25	2,25
Promedio	1,66	1,98	2,14	2,21	2,22
Saldo	700,0	3124,4	3124,4	4105,7	3699,9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de febrero de 2020	700,0	3124,4	3124,4	4105,7	3699,9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 17 al 21 de febrero del 2020	700,0	3124,4	3124,4	4105,7	3699,9
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	200,0	200,0
Vencimiento de Coloc-TP del 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados 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 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
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	800,0	800,0	800,0	800,0	800,0
Vencimiento de REPO del 17 al 21 de febrero 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					
Mínima					
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 17 al 21 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					
Mínima					
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 17 al 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas	225,5				
Plazo de vencimiento	58,4				
Tasas de interés	1,46				
Mínima	1,87				
Máxima	1,64				
Promedio	1,67				
Saldo	0,0	525,5	525,5	525,5	525,5
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de marzo de 2020	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de SC - Venta del 17 al 21 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					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra el 21 de febrero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 17 al 21 de febrero 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\$)					
Tipo de cambio cronometrado					
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio cronometrado					
ii. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	310,6	0,0	0,0	0,0
i. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	310,6	0,0	0,0	0,0
ii. Compras 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					
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 147,0	5 266,3	3 741,0	3 878,2	3 498,3
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0074%	0,0074%	0,0074%	0,0074%	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 revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	200,0	0,0	330,0	320,0	785,0
Tasas 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	3 947,0	5 266,9	3 411,0	3 268,2	2 674,3
f. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	9 735,5	9 735,7	9 762,5	9 762,5	9 715,7
g. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,9	5,9	6,0	5,9	5,9
h. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 081,7	3 030,3	3 874,9	3 874,9	3 019,9
i. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,3	2,3	2,3	2,3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	977,5	707,0	1 426,0	678,5	875,5
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25	2,20/2,30/2,25	2,00/2,25/2,22	2,00/2,25/2,23
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 y CDV	17,0	1,75/1,75/1,75			1,75/1,75/1,75
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)	15 / 2,07				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)					
Flojo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-69,5	-69,5	-28,9	-69,3	-132,0
Flojo de la posición comercial = a + b1 - c1 + e + f + g	41,2	41,2	41,7	41,7	376,2
a. Mercado spot con el público	-76,7	-44,1	-42,1	-29,7	-381,9
Compras	442,3	331,1	224,1	224,1	331,2
i. (-) Ventas	519,3	499,2	326,0	316,4	713,0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	26,3	106,2	106,2	106,2	270,0
i. (-) Ventas	261,4	442,3	379,6	387,4	276,9
ii. Compras	235,1	170,0	272,7	180,9	346,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	36,0	114,6	46,6	181,5	-513,5
i. (-) Ventas	348,1	448,3	398,1	348,1	531,4
ii. Compras	312,1	333,7	287,3	267,4	1044,9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	936,0	752,2	670,2	601,4	1193,0
ii. A futuro	30,0	98,0	63,0	63,0	117,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	100,1	167,6	6,7	93,7	499,6
i. Compras	399,4	331,9	261,1	251,9	1976,6
ii. (-) Ventas	299,3	163,7	261,2	158,2	617,0
f. Efectos de Opciones	4,1	18,4	10,7	9,6	-1,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-7,3	-22,1	-10,1	3,6	4,9
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Dabnet)	3,3890	3,3967	3,3879	3,3817	3,3843
(*) Datos preliminares					