

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	24 Feb 20	25 Feb 20	26 Feb 20	27 Feb 20	28 Feb 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 454,3	341,6	908,2	918,0	61,0
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	112,6	122,0	33,0	75,0	
Tasas de interés	152,4	30,4	678,4	1041,1	
Mínima	2,0	2,15	2,22	2,34	
Máxima	2,15	2,18	2,30	2,38	
Promedio	2,13	2,17	2,28	2,36	
Saldo	30 847,7	30 877,7	30 807,7	30 937,7	30 937,7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de marzo de 2020	1 757,9		1 757,9		1 757,9
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0		0,0		1 857,9
ii. Subasta de Compra Temporales de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas		300,0		500,0	500,0
Plazo de vencimiento		830,0		1080,0	1105,0
Tasas de interés		182,4		1,4	3,4
Mínima		3,15		2,41	2,61
Máxima		3,15		2,51	2,61
Promedio		3,15		2,47	2,61
Saldo	3 850,0	4 150,0	4 150,0	4 650,0	5 100,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 2 de marzo de 2020	300,0		300,0		650,0
Vencimiento de Repo de Valores del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0		0,0		1 250,0
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 CCDD BCRP el 1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CCDD BCRP del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas	500,0				
Plazo de vencimiento	1018,2				
Tasas de interés	1,4				
Mínima	1,80				
Máxima	2,22				
Promedio	2,14				
Saldo	500,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	500,0				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 6 de marzo del 2020	500,0				
iv. 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 2 al 6 de marzo del 2020	0,0		0,0		0,0
v. 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				
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0				
vi. Compra con compromiso de Recombro de moneda extranjera (Resuan)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	10 250,1	9 650,1	9 650,1	9 650,1	9 650,1
Próximo vencimiento de Repo Resuan el 2 de marzo de 2020	600,0		300,0		300,0
Vencimiento de REPO del 2 al 6 de marzo del 2020	600,0		0,0		1 100,1
vii. Compra con compromiso de Recombro 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				
Vencimiento de REPO Exansión del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0				
viii. Compra con compromiso de Recombro de moneda extranjera (Substitución)					
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 Substitución	0,0				
Vencimiento de REPO Substitución del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0				
ix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas			300,0	650,0	300,1
Plazo de vencimiento			60,4	10,6	60,4
Tasas de interés			0,85	1,00	1,00
Mínima			1,23	1,14	1,20
Máxima			1,01	1,14	1,20
Promedio			1,01	1,14	1,20
Saldo	625,5	525,5	625,5	825,5	1 125,6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de marzo de 2020	300,0		300,0		300,0
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0		0,0		0,0
x. 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				
Vencimiento de SC - Compra del 2 al 6 de marzo del 2020	0,0				
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
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	924,3	611,6	876,2	1 388,0	1 011,0
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Comisión (tasa efectiva anual)	0,0074%	0,0074%	0,0074%	0,0073%	0,0083%
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					
Depósitos Overmight en moneda nacional	50,0	5,8	3,5	52,4	288,0
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	874,3	695,8	874,7	1 335,6	723,0
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	8 743,5	8 572,4	8 572,4	8 552,2	8 490,3
g Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,3	5,2	5,2	5,2	5,1
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 844,8	2 674,9	2 674,9	2 625,3	2 588,8
i 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	1 074,5	1 473,0	1 025,9	851,9	1 578,6
Tasas de interés: Mínimo / Máximo / Promedio	2 202,25/2,25	2 252,30/2,25	2 252,30/2,25	2 202,30/2,26	2 252,25/2,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínimo / Máximo / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
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\$)					
Flojo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-4,9	-19,5	-34,0	161,2	188,1
Flojo de la posición corral = a + b1 - c1 + e + f + g	-35,9	-23,9	-26,0	41,1	34,9
a. Mercado spot con el público	-14,0	0,6	13,9	34,9	-125,5
i. Compras	500,0	276,6	242,2	466,2	442,5
ii. Ventas	314,5	278,1	429,2	328,6	668,0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	36,7	16,4	15,4	177,9	177,9
i. Pacjetas	209,1	256,9	239,2	319,9	362,2
ii. Ventas	172,3	99,1	123,8	223,8	184,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	0,9	204,5	85,6	-336,4	333,1
i. Pacjetas	277,7	333,2	462,3	795,9	495,5
ii. Ventas	276,8	128,7	376,7	1131,9	272,4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	493,3	526,1	548,4	632,0	632,0
ii. Al cobro	23,0	194,0	12,0	131,9	271,2
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	88,8	41,7	165,4	652,8	114,1
i. Compras	265,9	130,0	399,8	119,9	271,2
ii. Ventas	166,5	86,4	204,4	518,8	157,1
f. Efectos de Opciones	-6,5	11,1	10,1	19,7	24,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-10,9	11,1	0,0	6,7	91,4
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Dabnet)	3,3927	3,4042	3,4044	3,4109	3,4311
(*) Datos preliminares					