

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	02 Dic 19	03 Dic 19	04 Dic 19	05 Dic 19	06 Dic 19
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>2 765,1</b>	<b>417,0</b>	<b>1 152,0</b>	<b>2 810,3</b>	<b>3 097,2</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0		30,0	30,0	
Plazo de vencimiento	170,2		170,2	170,2	
Tasas de interés: Mínima	165,4		165,4	165,4	
Máxima	2,13		2,20	2,15	
Promedio	2,15		2,25	2,20	
Saldo	2,14		2,23	2,20	
Potencial vencimiento de CD BCRP el 12 de diciembre de 2019	29 938,0	28 211,5	28 241,5	28 271,5	28 271,5
Vencimiento de CD BCRP del 9 al 13 de diciembre del 2019	1 728,5	114,0	114,0	114,0	114,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)	2000,0	300,0	700,0	300,0	1700,0
Vencimiento de REPO del 9 al 13 de diciembre del 2019	5130,0	895,0	1900,0	3100,0	815,0
Propuestas recibidas	4710,0	2230,0	3230,0	805,0	2105,0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Tasas de interés: Mínima	2,36	2,35	2,32	2,36	2,43
Máxima	2,76	2,50	2,37	3,29	2,88
Promedio	2,50	2,46	2,35	3,31	2,62
Saldo	8 000,0	7 400,0	7 500,0	7 200,0	7 200,0
Potencial vencimiento de Repo de Valores el 9 de diciembre de 2019	4 300,0	3 700,0	3 700,0	3 600,0	3 600,0
Vencimiento de Repo de Valores del 9 al 13 de diciembre del 2019	4 300,0	3 700,0	3 800,0	3 600,0	3 600,0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Potencial vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 13 de diciembre del 2019	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
Potencial vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 9 al 13 de diciembre del 2019	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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Potencial vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 9 al 13 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Rescatar)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11 250,1	11 250,1	11 250,1	11 050,1	11 050,1
Potencial vencimiento de Repo Regular el 3 de febrero de 2020	500,0	200,0	200,0	500,0	500,0
Vencimiento de REPO del 9 al 13 de diciembre del 2019	700,0	200,0	200,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recupera de moneda extranjera (Excepción)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Potencial vencimiento de Repo Extension	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 9 al 13 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recupera 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
Potencial vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 9 al 13 de diciembre del 2019	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
Potencial 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 9 al 13 de diciembre del 2019	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
Potencial vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 9 al 13 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR (Compras (millones de US\$))					
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\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	44,2	0,0	0,0	0,0	1,9
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	44,2	0,0	0,0	0,0	1,9
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					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4 614,1</b>	<b>4 917,0</b>	<b>4 922,0</b>	<b>4 760,3</b>	<b>4 797,2</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Comera mensual de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0074%	0,0074%	0,0074%	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	300,0	150,0	250,0	251,2	204,7
Depósitos Overnight en moneda nacional	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%	1,00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>4 315,1</b>	<b>4 767,0</b>	<b>4 664,0</b>	<b>4 529,1</b>	<b>4 599,5</b>
i. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 113,6	3 043,1	3 215,0	3 281,5	3 161,6
ii. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,7	5,4	5,7	5,9	5,9
iii. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 495,5	3 105,7	3 434,0	3 019,4	3 215,2
iv. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	1,9	2,3	2,4	2,4
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CD BCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	661,1	661,1	1 043,6	1 063,5	996,9
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,30/2,25	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\$)	38,0	38,0	38,0	38,0	38,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75	1,75/1,75/1,75
c. Total mercado secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>29 Noviembre 19</b>	<b>02 Diciembre 19</b>	<b>03 Diciembre 19</b>	<b>04 Diciembre 19</b>	<b>05 Diciembre 19</b>
Flujo de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g	-99,9	-99,9	-99,9	-112,2	-41,3
Flujo de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g	-47,8	6,8	-24,2	-124,4	24,2
a. Mercado spot con el público	-96,1	-0,4	-98,5	-133,5	5,6
Compras	395,3	463,3	307,7	307,7	307,9
i. ( ) Ventas	451,3	396,5	322,0	439,3	322,2
b. Compra de netos y swap al público (con y sin entrega)	-61,3	191,1	75,2	102,6	-246,3
i. ( ) Pactadas	150,5	333,7	209,1	200,9	60,7
ii. ( ) Venidas	244,0	127,6	133,9	99,2	291,4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-45,6	121,6	129,9	1,0	-147,4
Pactadas	261,1	491,8	476,1	254,3	286,9
i. ( ) Ventadas	306,7	370,1	353,9	233,4	434,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	454,7	627,1	715,3	386,0	230,3
ii. Al plazo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	104,7	259,3	224,5	139,9	157,8
Compras	244,8	292,9	224,8	220,2	117,8
i. ( ) Ventas	140,3	98,9	2,8	9,0	269,8
ii. ( ) Ventas	3,2	4,4	2,8	0,0	1,8
d. Operaciones netas con otras instituciones financieras	6,3	-6,5	-0,8	0,3	-4,0
Compras					
ii. Crédito por reposición monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databe)	3,3990	3,4007	3,3867	3,3827	3,3762
(*) Datos preliminares					