

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Dic 19	17 Dic 19	18 Dic 19	19 Dic 19	20 Dic 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	3 754,9	3 179,5	2 420,2	1 005,8	756,6
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos en BCR (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30,0	134,8	30,0	30,0	161,9
Plazo de vencimiento	251,0	533,4	350,0	350,0	345,0
Tasas de interés	2,11	2,21	2,14	2,14	2,40
Máxima	2,11	2,24	2,17	2,17	2,85
Promedio	2,11	2,22	2,17	2,17	2,60
Saldo	28 214,6	28 214,6	28 214,6	28 274,6	28 274,6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de enero de 2020	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0	1 585,0
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Comera Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas			500,0	350,0	500,0
Plazo de vencimiento			1000,0	350,0	500,0
Tasas de interés			7,4	1,0	7,4
Máxima			2,82	2,35	2,92
Promedio			2,82	2,61	2,92
Saldo	5 200,0	5 200,0	4 700,0	5 050,0	5 545,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de diciembre de 2019	500,0	500,0	500,0	350,0	545,0
Vencimiento de Repo Valores del 23 al 27 de diciembre del 2019	1 000,0	1 000,0	500,0	1 200,0	1 685,0
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 23 al 27 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	800,0	1300,0	400,0	500,0	345,0
Plazo de vencimiento	165,2	1496,1	969,8	1000,0	1000,0
Tasas de interés	1,4	1,4	1,4	1,4	3,1
Máxima	1,41	1,64	1,65	1,65	2,40
Promedio	1,50	1,52	1,65	1,65	2,85
Saldo	800,0	1 300,0	400,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	800,0	1 300,0	400,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 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	800,0	1 300,0	400,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	800,0	1 300,0	400,0	0,0	0,0
Tasas de interés	1,68	1,52	1,65	1,65	1,65
Máxima	1,68	1,52	1,65	1,65	1,65
Promedio	1,68	1,52	1,65	1,65	1,65
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 23 de diciembre de 2019	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 23 al 27 de diciembre del 2019	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					
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 23 al 27 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resatari)					
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 23 al 27 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Exansion)					
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 Exansion	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Exansion del 23 al 27 de diciembre del 2019	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 23 al 27 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					
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 23 al 27 de diciembre del 2019	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	224,8	0,0	0,5	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	224,8	0,0	0,5	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 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	3 824,9	1 878,5	1 980,2	1 975,8	1 661,6
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%	0,0085%
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 reabsorción monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	663,1	207,1	28,4	122,5	253,0
Depósitos Overmort en moneda nacional	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	2 281,8	1 872,4	1 981,8	1 853,3	1 348,6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 526,9	9 334,5	9 252,7	9 206,9	9 115,7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,0	5,9	5,8	5,7	5,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 990,7	3 821,9	3 879,2	3 804,0	3 511,1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,6	2,4	2,3	2,2	2,2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	912,0	1 134,2	1 672,0	1 672,0	1 631,6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,252/2,252/2,25	2,202/2,252/2,24	2,252/2,252/2,25	2,252/2,252/2,25	2,252/2,252/2,25
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 1 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Mercado de divisas					
Flojo de la posición (dólar = a + b) - (c) + e + f + g	60,8	40,3	-76,1	-113,2	-109,0
Flojo de la posición (euro = a + b) - (c) + e + f + g	6,8	49,9	-35,1	-42,2	-140,4
a. Mercado spot con el público	-0,4	56,1	-54,6	-28,0	-31,3
i. Compras	431,8	130,9	442,2	442,2	416,3
ii. Ventas	431,8	446,8	423,2	410,9	441,6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	77,1	-11,9	71,9	30,4	152,5
i. Facturas	163,9	270,4	260,0	142,4	239,4
ii. Ventas	86,8	304,4	225,7	109,0	91,8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	24,4	-32,2	66,1	-27,6	-192,8
i. Facturas	32,7	616,8	497,5	390,1	432,7
ii. Ventas	303,3	948,8	229,4	377,8	625,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	576,4	569,9	694,0	834,0	758,3
ii. Al plazo	0,0	48,6	0,0	60,3	3,9
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	227,8	446,6	30,2	230,7	133,1
f. Compras	277,0	750,9	186,5	313,2	310,8
g. Ventas	49,2	303,3	156,3	82,5	377,5
h. Efectos de Comercio	1,1	10,3	0,0	0,0	0,0
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-4,1	-23,3	-14,9	-4,4	-6,5
ii. Crédito por reabsorción monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,4	3,3565	3,3565	3,3382	3,3376
(*) Datos preliminares					