

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**  
(Millones de Soles)

	30 Dic 19	31 Dic 19	02 Ene 20	03 Ene 20
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>176,1</b>	<b>761,8</b>	<b>644,9</b>	<b>2 889,6</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	
Plazo de vencimiento	120,6		203,0	
Tasas de Int. Mínima	185 d		369 d	
Máxima	2,02		2,07	
Promedio	2,08		2,08	
Saldo	28 364,5	28 364,5	28 364,5	26 809,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de enero de 2020	1 585,0	1 585,0	1 585,0	325,0
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de enero de 2020	1 585,0	1 585,0	1 910,0	325,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1100,0	700,0	1000,0	1700,0
Propuestas recibidas	1590,0	1200,0	1000,0	2500,0
Plazo de vencimiento	1 d	2 d	2 d	1 d
Tasas de Int. Mínima	2,71	2,70	2,25	2,76
Máxima	2,75	2,70	2,80	2,76
Promedio	2,75	2,70	2,61	2,43
Saldo	5 750,0	6 350,0	7 650,0	5 550,0
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 6 de enero de 2020	1 100,0	2 500,0	3 800,0	1 700,0
Vencimiento de Reco Valores del 6 al 10 de enero del 2020	1 900,0	2 500,0	3 800,0	1 700,0
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de enero del 2020	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 Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloco-TP el 23 de enero de 2020	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloco-TP del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	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
Vencimiento de Repo del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Expansión del 6 al 10 de enero del 2020	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 Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo Sustitución del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	900,0	900,0	900,0	900,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de enero de 2020	600,0	600,0	600,0	600,0
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de Int. Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 6 al 10 de enero del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US\$)				
Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0	0,0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	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 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>1 246,1</b>	<b>2 461,8</b>	<b>4 414,9</b>	<b>4 559,6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0084%	0,0076%	0,0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)				
Tasa de interés	2,80%	2,80%	2,80%	2,80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés	676,0	1 130,0	0,0	60,0
d. Depósitos Overnigt en moneda nacional	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>570,1</b>	<b>1 331,8</b>	<b>4 414,9</b>	<b>4 529,6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)(*)	8 348,9	8 268,5	8 248,5	9 129,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)(**)	5,2	5,1	5,1	5,6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 728,8	2 654,3	2 636,7	3 397,2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE)(**)	1,7	1,6	1,6	2,1
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 374,7	777,4	577,6	913,8
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,25/2,25/2,25	4,5/0	2,25/2,25/2,25	2,25/2,25/2,25
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 y CDV		1,75/1,75/1,75		
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>27 Diciembre 19</b>	<b>30 Diciembre 19</b>	<b>31 Diciembre 19</b>	<b>02 Enero 20</b>
Flujo de la posición global = a + b i - c i + e + f + g	46,3	42,7	-4,4	21,8
Flujo de la posición contable = a + b ii - c ii + e + f + g	-46,9	4,9	-16,3	26,0
a. Mercado spot con el público	-1,8	-60,5	-3,9	-114,1
i (-) Compras	426,0	371,0	385,7	233,1
ii (+) Ventas	427,7	431,4	389,6	347,2
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrea)	151,4	-139,5	-67,1	-291,5
i (-) Placadas	336,8	231,5	178,9	139,6
ii (+) Vencidas	207,4	371,1	146,0	431,1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrea)	58,4	-180,7	-77,7	-285,7
i (-) Placadas	388,0	270,2	85,3	404,9
ii (+) Vencidas	530,6	450,9	163,0	690,5
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	710,5	636,6	445,0	413,9
ii. A futuro	269,0	269,0	5,0	95,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrea	284,8	139,9	8,6	402,4
f. Compras	474,0	388,8	148,2	862,9
g. Ventas	189,2	139,9	139,6	290,5
f. Efecto de Opciones	0,0	-3,3	3,3	-0,3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	5,3	-5,9	-0,9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3,3231	3,3148	3,3120	3,3017