

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

|  | 18 Nov 19              | 19 Nov 19              | 20 Nov 19              | 21 Nov 19              | 22 Nov 19              |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| <b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>         | <b>3 570,5</b>         | <b>3 682,1</b>         | <b>2 148,8</b>         | <b>1 244,9</b>         | <b>1 239,9</b>         |
| <b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>                      |                        |                        |                        |                        |                        |
| <b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>  |                        |                        |                        |                        |                        |
| i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Propuestas recibidas   | 30,0                   | 120,5                  | 30,0                   | 30,0                   |                        |
| Plazo de vencimiento   | 176,4                  | 531,4                  | 218,0                  | 218,0                  |                        |
| Tasas de interés: Mínima   | 2,13                   | 2,30                   | 2,35                   | 2,16                   |                        |
| Máxima   | 2,18                   | 2,35                   | 2,35                   | 2,24                   |                        |
| Promedio   | 2,17                   | 2,20                   | 2,33                   | 2,20                   |                        |
| Saldo  | 29 758,0               | 29 758,0               | 29 780,0               | 29 818,0               | 29 818,0               |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de diciembre de 2019   | 1 726,5                | 1 726,5                | 1 726,5                | 1 726,5                | 1 726,5                |
| Vencimiento de CD BCRP del 25 al 29 de noviembre del 2019  | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Propuestas recibidas   | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  |
| Plazo de vencimiento   | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  |
| Tasas de interés: Mínima   | 3,05                   | 3,05                   | 3,05                   | 3,05                   | 3,05                   |
| Máxima   | 3,15                   | 3,15                   | 3,15                   | 3,15                   | 3,15                   |
| Promedio   | 3,10                   | 3,10                   | 3,10                   | 3,10                   | 3,10                   |
| Saldo  | 3 100,0                | 3 100,0                | 3 100,0                | 3 100,0                | 3 100,0                |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 25 de noviembre de 2019  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  |
| Vencimiento de Repo de Valores del 25 al 29 de noviembre del 2019  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  | 200,0                  |
| 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 CDOB BCRP el  | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| Vencimiento de CDOB BCRP del 25 al 29 de noviembre del 2019  | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional  | 1 300,0                | 1 499,9                | 900,0                  | 900,0                  | 900,0                  |
| Propuestas recibidas   | 2 492,1                | 2 499,9                | 916,5                  | 916,5                  | 916,5                  |
| Plazo de vencimiento   | 1,4                    | 1,4                    | 1,4                    | 1,4                    | 1,4                    |
| Tasas de interés: Mínima   | 1,74                   | 1,74                   | 1,74                   | 1,74                   | 1,74                   |
| Máxima   | 2,09                   | 2,05                   | 2,00                   | 2,00                   | 2,00                   |
| Promedio   | 1,98                   | 1,98                   | 1,91                   | 1,91                   | 1,91                   |
| Saldo  | 1 300,0                | 1 499,9                | 900,0                  | 900,0                  | 900,0                  |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo   | 1 300,0                | 1 499,9                | 900,0                  | 900,0                  | 900,0                  |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 29 de noviembre del 2019  | 1 300,0                | 1 499,9                | 900,0                  | 900,0                  | 900,0                  |
| v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Propuestas recibidas   |                        |                        | 1 179,5                |                        |                        |
| Plazo de vencimiento   |                        |                        | 386,9                  |                        |                        |
| Tasas de interés: Mínima   |                        |                        | 3,44                   |                        |                        |
| Máxima   |                        |                        | 4,01                   |                        |                        |
| Promedio   |                        |                        | 3,44                   |                        |                        |
| Saldo  | 4 100,2                | 4 100,2                | 4 100,2                | 4 100,2                | 4 100,2                |
| Próximo vencimiento de Coloc TP el 3 de diciembre de 2019  | 500,0                  | 500,0                  | 300,0                  | 300,0                  | 300,0                  |
| Vencimiento de Coloc TP del 25 al 29 de noviembre del 2019   | 500,0                  | 500,0                  | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reasignables 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 25 al 29 de noviembre del 2019   | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| vii. Compra con compromiso de Reconstrucción de moneda extranjera (Reconstr)                               |                        |                        |                        |                        |                        |
| Propuestas recibidas   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Plazo de vencimiento   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Tasas de interés: Mínima   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Máxima   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Promedio   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Saldo  | 11 550,1               | 11 550,1               | 11 550,1               | 11 550,1               | 11 550,1               |
| Próximo vencimiento de Repo Reconstr del 25 de noviembre de 2019   | 300,0                  | 300,0                  | 300,0                  | 300,0                  | 300,0                  |
| Vencimiento de REPO del 25 al 29 de noviembre del 2019   | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| viii. Compra con compromiso de Reconstrucción de moneda extranjera (Expansión)                             |                        |                        |                        |                        |                        |
| 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 Expansión  | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| Vencimiento de REPO Expansión del 25 al 29 de noviembre del 2019   | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| ix. Compra con compromiso de Reconstrucción 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 25 al 29 de noviembre 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                  |
| Próximo 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 25 al 29 de noviembre 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                    |
| Próximo vencimiento de SC Compra   | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| Vencimiento de SC - Compra del 25 al 29 de noviembre del 2019  | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    | 0,0                    |
| <b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>   |                        |                        |                        |                        |                        |
| i. Compras (millones de US\$)  |                        |                        |                        |                        |                        |
| Tipo de cambio promedio  |                        |                        |                        |                        |                        |
| i. Ventas (millones de US\$)   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Tipo de cambio promedio  |                        |                        |                        |                        |                        |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público   |                        |                        |                        |                        |                        |
| i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público   |                        |                        |                        |                        |                        |
| ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público   |                        |                        |                        |                        |                        |
| 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 / 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>2 270,5</b>         | <b>2 182,1</b>         | <b>1 748,8</b>         | <b>1 414,9</b>         | <b>1 239,9</b>         |
| <b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>                                     |                        |                        |                        |                        |                        |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Comisión tasa efectiva diaria  | 0,0075%                | 0,0074%                | 0,0074%                | 0,0075%                | 0,0074%                |
| 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 reasignación monetaria en moneda nacional   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Depósitos Overnight en moneda nacional   | 82,1                   | 235,0                  | 474,8                  | 595,8                  | 519,8                  |
| Tasa de interés  | 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>2 188,4</b>         | <b>1 927,1</b>         | <b>1 274,0</b>         | <b>891,1</b>           | <b>726,1</b>           |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)                                 | 9 000,8                | 9 000,8                | 8 927,3                | 8 927,3                | 8 665,5                |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                 | 5,7                    | 5,7                    | 5,6                    | 5,5                    | 5,5                    |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)                                    | 3 485,1                | 3 397,1                | 3 310,5                | 3 182,4                | 3 054,3                |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)                                    | 2,2                    | 2,1                    | 2,1                    | 2,0                    | 1,9                    |
| <b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>   |                        |                        |                        |                        |                        |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional   | 638,0                  | 681,0                  | 811,0                  | 1 012,0                | 1 530,0                |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   | 2,25/2,25/2,25         | 2,25/2,25/2,25         | 2,25/2,25/2,25         | 2,25/2,25/2,25         | 2,25/2,25/2,25         |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)  |                        | 66,0                   | 40,0                   | 60,0                   | 60,0                   |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio   |                        | 1,75/1,75/1,75         |                        | 1,71/1,75/1,75         | 1,71/1,75/1,75         |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP/NR y CDV   |                        |                        |                        |                        |                        |
| 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>15 Noviembre 19</b> | <b>18 Noviembre 19</b> | <b>19 Noviembre 19</b> | <b>20 Noviembre 19</b> | <b>21 Noviembre 19</b> |
| Pago de la posición global = a + b1 - c1 + e + f + g   | 13,8                   | -9,7                   | -8,9                   | -8,8                   | -8,9                   |
| Pago de la posición contable = a + b1 - c1 + e + f + g   | 82,1                   | 30,3                   | 20,7                   | 22,8                   | 181,0                  |
| a. Mercado spot con el público   | 89,8                   | 57,4                   | -3,4                   | -6,9                   | -51,3                  |
| i. Compras   | 209,9                  | 300,0                  | 233,0                  | 411,8                  | 381,5                  |
| ii. Ventas   | 325,9                  | 243,1                  | 336,8                  | 338,8                  | 432,8                  |
| b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)   | 16,8                   | -8,0                   | -16,8                  | -16,8                  | 0,0                    |
| i. Placados  | 124,6                  | 123,0                  | 218,8                  | 217,2                  | 314,3                  |
| ii. Ventas   | 143,2                  | 163,7                  | 294,9                  | 314,4                  | 376,4                  |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)  | 52,4                   | 64,5                   | -18,1                  | -16,5                  | -217,6                 |
| i. Placados  | 240,8                  | 223,2                  | 316,8                  | 294,8                  | 485,1                  |
| ii. Ventas   | 288,2                  | 164,8                  | 534,3                  | 283,4                  | 906,7                  |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias   |                        |                        |                        |                        |                        |
| i. Al cobrado  | 534,0                  | 360,0                  | 497,0                  | 497,0                  | 491,5                  |
| ii. Al cobrado   | 80,0                   | 180,0                  | 23,0                   | 11,0                   | 30,0                   |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega                               |                        |                        |                        |                        |                        |
| i. Compras   | 120,6                  | 42,0                   | 291,1                  | 179,1                  | 397,9                  |
| ii. Ventas   | 220,8                  | 162,0                  | 281,3                  | 511,1                  | 754,8                  |
| f. Efecto de liquidación   | 109,5                  | 121,8                  | 102,1                  | 118,0                  | 356,9                  |
| g. Efecto de liquidación   | -3,8                   | 11,2                   | -2,4                   | -1,9                   | 0,8                    |
| h. Operaciones netas con otras instituciones financieras   | -2,3                   | 0,9                    | 3,3                    | -2,8                   | 0,8                    |
| i. Crédito por reasignación monetaria en moneda extranjera   |                        |                        |                        |                        |                        |
| Tasa de interés  |                        |                        |                        |                        |                        |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Databeek)   | 3,3705                 | 3,3706                 | 3,3799                 | 3,3866                 | 3,3789                 |
| (*) Datos preliminares   |                        |                        |                        |                        |                        |