BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	09 Dic 19	10 Dic 19	11 Dic 19	12 Dic 19	13 Dic 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**2 987,0**	**3 042,7**	**2 229,8**	**3 313,3**	**3 667,1**
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)	30.1		30.0	30.0	
Propuestas recibidas	203.4		121.0	125.6	
Plazo de vencimiento	178 d		540 d	357 d	
Tasas de inte Mínima	2.12		2.20	2.15	
Máxima	2.15		2.25	2.19	
Promedio	2.14		2.23	2.17	
Saldo	28 301.6	28 301.6	28 331.6	28 247.6	28 184.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de enero de 2020	114.0		114.0		1 585.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de diciembre del 2019	114.0		114.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	2000.0	1400.0	300.0 500.0 1500.0	500.0 500.0	400.0
Propuestas recibidas	2715.0	3350.0	745.0 1030.0 2700.0	1000.0 1090.0	500.0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	183 d 7 d 1 d	7 d 1 d	3 d
Tasas de inte Mínima	2.25	2.40	3.27 2.35 2.50	2.40 2.36	2.42
Máxima	2.86	2.60	3.27 2.35 2.50	2.40 2.57	2.42
Promedio	2.67	2.49	3.27 2.35 2.50	2.40 2.40	2.42
Saldo	7 100.0	6 500.0	6 200.0	5 700.0	5 600.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 16 de diciembre de 2019	2 000.0		1 500.0		400.0
Vencimiento de Repo Valores del 16 al 20 de diciembre del 2019	3 200.0		1 500.0		1 400.0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
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 16 al 20 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 inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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 23 de diciembre de 2019	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
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
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		300.0			
Propuestas recibidas		1035.0			
Plazo de vencimiento		62 d			
Tasas de inte Mínima		-0.20			
Máxima		0.14			
Promedio		-0.03			
Saldo	600.0	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
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inte 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
Vencimiento de SC - Compra del 16 al 20 de diciembre del 2019	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público	0.0		0.0		0.0
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público	0.0		0.0		0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 957.0**	**4 442.7**	**4 499.8**	**4 283.3**	**4 067.1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0074%	0.0074%	0.0074%	0.0074%	0.0075%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	120.0	0.0	4.0	259.4	707.0
Tasa de interés	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 837.0**	**4 442.7**	**4 495.8**	**4 023.9**	**3 360.1**
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 722.8	9 780.6	9 802.8	9 792.8	9 782.1
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.1	6.1	6.1	6.1	6.1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 148.0	4 201.9	4 223.8	4 211.6	4 197.1
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.6	2.6	2.6	2.6	2.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 174.0	1 218.9	1 307.5	1 583.7	1 787.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.25/2.25/2.25	2.25/2.25/2.25	2.25/2.30/2.25	2.25/2.30/2.25	2.25/2.25/2.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)				9.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio				1.75/1.75/1.75	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	5.0	15.0			6.6
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					6.6/2.17
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)	5/2.25				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**09 Diciembre 19**	**09 Diciembre 19**	**10 Diciembre 19**	**11 Diciembre 19**	**12 Diciembre 19**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-103.9	-103.9	-0.3	-42.1	103.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	7.6	7.6	2.6	-2.2	18.7
a. Mercado spot con el público	7.7	7.7	-119.6	-4.9	-31.7
i. Compras	330.6	330.6	365.3	377.7	509.0
ii. (-) Ventas	322.9	322.9	484.9	382.7	540.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	186.8	186.8	62.4	-205.6	-30.7
i. Pactadas	367.9	367.9	359.8	109.7	338.0
ii. (-) Vencidas	181.1	181.1	297.4	315.2	368.7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	299.0	299.0	152.5	-165.3	-114.0
i. Pactadas	451.4	451.4	504.3	239.0	509.5
ii. (-) Vencidas	152.4	152.4	351.8	404.4	623.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	383.5	383.5	669.3	812.0	536.6
ii. A futuro	84.0	84.0	75.0	6.0	23.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-28.7	-28.7	162.0	95.4	306.3
i. Compras	116.6	116.6	350.0	404.1	613.9
ii. (-) Ventas	145.3	145.3	188.0	308.7	307.6
f. Efecto de Opciones	0.7	0.7	-1.3	0.3	1.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.2	-0.2	103.0	-3.5	-1.1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3798	3,3798	3,3798	3,3918	3,3923
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera