

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Dic 19	24 Dic 19	26 Dic 19	27 Dic 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-880,4	698,3	828,9	1 423,9
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)				
Propuestas recibidas	30,0		30,0	201,9
Plazo de vencimiento	125,6		357 d	343 d
Tasas de inte Mínima	2,15		2,08	2,08
Máxima	2,19		2,08	2,08
Promedio	2,17		2,08	2,08
Saldo	28 304,5	28 304,5	28 334,5	28 334,5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de enero de 2020		1 586,0		1 586,0
Vencimiento de CD BCRP del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		0,0		1 586,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)				
Propuestas recibidas	1000,0	1000,0	1500,0	800,0
Plazo de vencimiento	2000,0	2000,0	1850,0	1500,0
Tasas de inte Mínima	1 d	7 d	2 d	7 d
Máxima	2,61	2,50	2,65	2,72
Promedio	2,65	2,52	2,75	2,72
Saldo	7 000,0	7 350,0	6 150,0	5 650,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de diciembre de 2019		2 000,0		1 000,0
Vencimiento de Repo Valores del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		2 500,0		1 800,0
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de inte Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el				
Vencimiento de CDLD BCRP del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		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
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo				
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		0,0		0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público				
Propuestas recibidas	500,0			
Plazo de vencimiento	1013,0			
Tasas de inte Mínima	366 d			
Máxima	3,45			
Promedio	4,06			
Saldo	4 100,2	4 100,2	4 100,2	4 100,2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 23 de enero de 2020		500,0		500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		0,0		0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de inte Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP				
Vencimiento de CDR BCRP del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		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
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de febrero de 2020		500,0		500,0
Vencimiento de REPO del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		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
Próximo vencimiento de Repo Expansión				
Vencimiento de REPO Expansión del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		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
Próximo vencimiento de Repo Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		0,0		0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de inte 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
Vencimiento de SC - Venta del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		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
Próximo vencimiento de SC-Compra				
Vencimiento de SC - Compra del 30 de diciembre del 2019 al 3 de enero del 2020		0,0		0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR				
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	-15,8	15,1	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,3	15,1	0,0	0,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR v BTP	16,1	0,0	0,0	0,0
i. Compras de CD BCRP v 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	1 589,6	2 198,3	1 628,9	1 423,9
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%	0,0083%	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				
d. Depósitos Overnigh en moneda nacional	155,1	493,0	638,0	460,1
Tasa de interés	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	1 434,5	1 705,3	990,9	963,9
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8 821,2	8 748,3	8 425,4	8 425,4
g Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,5	5,4	5,4	5,4
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 210,8	3 136,8	2 934,9	2 934,9
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,0	1,9	1,9	1,9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 801,0	1 086,8	1 563,6	1 592,0
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
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 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	20 Diciembre 19	23 Diciembre 19	24 Diciembre 19	26 Diciembre 19
Flujo de la posición global = a + b - c - i + e + f + g	185,9	-2,8	-58,4	-24,9
Flujo de la posición contable = a + b - c - i + e + g	351,7	249,3	-52,5	-3,4
a. Mercado spot con el público	344,3	101,1	-57,7	-28,5
i. Compras	831,6	410,4	118,4	350,0
ii. (-) Ventas	487,3	309,3	176,1	378,6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrea)	115,0	-170,2	-191,2	28,2
i. Placadas	253,1	272,3	41,0	203,5
ii. (-) Vencidas	138,1	442,5	232,2	175,3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrea)	280,7	81,8	-185,2	49,7
i. Placadas	521,3	710,2	66,2	178,3
ii. (-) Vencidas	240,6	628,4	251,4	129,6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	1070,0	753,6	322,2	694,0
ii. Futuro	38,0	55,9	0,0	140,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrea	131,1	346,5	45,7	-5,3
i. Compras	231,5	566,4	241,1	127,8
ii. (-) Ventas	100,4	219,9	195,4	133,1
f. Efecto de Opciones	0,0	0,0	0,1	0,0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-21,2	-12,5	-21,2	-15,3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datastat)	3,3220	3,3174	3,3140	3,3205
(*) Tasa ponderada				