BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	15 Jun 20		16 Jun 20		17 Jun 20		18 Jun 20		19 Jun 20	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**17,661.0**		**17,423.5**		**17,185.5**		**16,719.5**		**16,394.4**	
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 BCR)	66.1	300.0	100.0	300.0	100.0	300.0	50.0	300.0	100.0	250.0
Propuestas recibidas	132.1	630.0	182.0	435.0	197.0	622.5	61.0	525.0	146.0	250.0
Plazo de vencimiento	171 d	29 d	170 d	28 d	169 d	34 d	180 d	33 d	179 d	32 d
Tasas de interés: Mínima	0.34	0.24	0.35	0.24	0.35	0.24	0.35	0.24	0.35	0.24
Máxima	0.35	0.25	0.35	0.25	0.35	0.25	0.35	0.25	0.35	0.25
Promedio	0.35	0.25	0.35	0.24	0.35	0.25	0.35	0.25	0.35	0.25
Saldo	29,382.6		30,221.7		30,621.7		30,771.7		30,471.7	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 22 de Junio del 2020	250.0		250.0		250.0		700.0		234.0	
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de Junio del 2020	950.0		950.0		950.0		1,672.0		972.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	15,537.0		15,437.0		15,517.0		15,517.0		15,517.0	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Junio del 2020	100.0		150.0		150.0		150.0		150.0	
Vencimiento de Repo Valores del 22 al 26 de Junio del 2020	100.0		0.0		0.0		350.0		350.0	
iii. Subasta de Cartera Temporal de Carteras de Créditos (General)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	10.0		10.0		10.0		10.0		10.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General el 14 de Agosto del 2020	10.0		10.0		10.0		10.0		10.0	
Vencimiento de Repo de Cartera General del 22 al 26 de Junio del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
iv. Subasta de Cartera Temporal de Carteras de Créditos (Alternativa)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	250.0		250.0		250.0		250.0		250.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 23 de Julio del 2020	150.0		150.0		150.0		150.0		150.0	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 22 al 26 de Junio del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
v. Subasta de Cartera Temporal de Carteras de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)										
Garantía para los créditos										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo adjudicado	29,795.9		29,795.9		29,795.9		29,795.9		29,795.9	
vi. Subasta de Cartera Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)										
Garantía para los créditos										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo adjudicado	204.1		204.1		204.1		204.1		204.1	
vii. Subasta de Cartera Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR										
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 22 al 26 de Junio del 2020										
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDV BCRP										
Vencimientos de CDV BCRP del 22 al 26 de Junio del 2020										
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDLD BCRP										
Vencimiento de CDLD BCRP del 22 al 26 de Junio del 2020										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,999.9	9,539.4	2,000.0	9,905.8	2,499.8	9,288.1	2,500.0	9,907.1	2,500.1	9,000.2
Propuestas recibidas	2,438.5	9,539.4	2,885.0	9,905.8	3,580.5	9,288.1	3,310.0	9,907.1	3,292.5	9,000.2
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	0.22	0.23	0.24	0.23	0.21	0.23	0.22	0.23	0.23	0.23
Máxima	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25
Promedio	0.25	0.25	0.25	0.25	0.24	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25
Saldo	9,799.7		21,405.2		20,787.6		21,406.7		20,500.0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de Junio del 2020	2,000.0		12,409.5		11,788.0		12,407.0		11,000.1	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de Junio del 2020	9,799.7		17,405.3		14,287.9		21,406.7		20,500.0	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: 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 25 de Junio del 2020	300.0		300.0		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de Junio del 2020	0.0		0.0		0.0		300.0		300.0	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Coloc-BN										
Vencimiento de Coloc - BN del 22 al 26 de Junio del 2020										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	250.0		200.0		200.0		300.0			
Propuestas recibidas	350.0		410.0		400.0		660.0			
Plazo de vencimiento	60 d		62 d		61 d		61 d			
Tasas de interés: Mínima			0.0		0.0		0.00			
Máxima			0.0		0.0		0.04			
Promedio			0.0		0.0		0.01			
Saldo	1,080.0		1,280.0		1,480.0		1,780.0		1,780.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Julio del 2020	180.0		180.0		180.0		180.0		180.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de Junio del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Incorporación Reemplazable (CDBCRP-NR)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR										
Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de Junio del 2020										
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	8,745.0		8,745.0		8,745.0		8,745.0		8,745.0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 22 de Junio del 2020	200.0		200.0		200.0		200.0		200.0	
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de Junio del 2020	0.0		0.0		0.0		350.0		350.0	
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de recompra										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo										
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de Junio del 2020										
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo Expansión										
Vencimiento de REPO Expansión del 22 al 26 de Junio del 2020										
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo Sustitución										
Vencimiento de REPO Sustitución del 22 al 26 de Junio del 2020										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	250.1				200.0					
Propuestas recibidas	950.0				647.5					
Plazo de vencimiento	32 d				61 d					
Tasas de interés: Mínima	-0.60				-0.80					
Máxima	-0.40				-0.56					
Promedio	-0.53				-0.67					
Saldo	1,103.9		1,103.9		1,303.9		1,003.9		1,003.9	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Julio del 2020	300.0		300.0		300.0		194.2		194.2	
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de Junio del 2020	300.0		300.0		300.0		0.0		0.0	
xx. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento Mínima										
Tasas de interés: Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de SC-Compra										
Vencimiento de SC - Compra del 22 al 26 de Junio del 2020										
b. Liquidación de Repos de Carteras de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP y Circular 0017-2020-BCRP)	188.4		0.9		32.6		0.0		288.3	
c. 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										
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	1.6		308.2		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)	1.6		308.2		0.0		0.0		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP										
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP										
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,694.1**		**4,988.4**		**4,910.2**		**3,662.4**		**4,832.4**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps):										
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%		0.0015%		0.0015%		0.0015%		0.0015%	
b. Compra temporal directa de valores (Reparto subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,277.5		1,778.0		1,295.8		534.1		1,930.3	
Tasa de interés	0.10%		0.10%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4,416.6**		**3,210.4**		**3,614.4**		**3,128.3**		**2,902.1**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,544.0		10,681.1		9,949.2		9,942.3		9,870.1	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCAL) (*)	5.2		5.2		5.1		5.1		5.1	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,253.1		4,287.5		4,153.2		4,145.7		4,066.6	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCAL) (*)	2.2		2.2		2.1		2.1		2.1	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	259.0		260.0		120.0		748.0		656.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.15 / 0.20 / 0.19		0.15 / 0.25 / 0.19		0.15 / 0.20 / 0.19		0.15 / 0.20 / 0.17		0.10 / 0.20 / 0.14	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)									16.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio									0.25 / 0.25 / 0.25	
c. Total mercado secundario de COBCRP, COBCRP-NR y CDV							14.1		0.3	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)							5.3 / 0.25			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 36 meses (monto / tasa promedio)							8.8 / 0.75			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**12 Junio 20**		**15 Junio 20**		**16 Junio 20**		**17 Junio 20**		**18 Junio 20**	
Plazo de liquidación diario: = a + b1 - c1 + d + f1 + g	48.8		27.2		11.9		3.8		12.7	
Plazo de liquidación cambiario: = a + b1 - c1 + d + e + f1 + g	27.2		27.2		11.9		-186.0		12.7	
a. Mercado interbancario público	-177.2		-125.4		-94.0		-186.0		-68.9	
i. Compras	383.7		255.8		187.2		236.5		301.0	
ii. Ventas	561.0		381.3		281.3		422.5		369.9	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-125.7		29.3		-91.5		25.3		-265.6	
i. Pactadas	167.9		333.4		146.3		257.3		300.1	
ii. Vencidas	293.6		304.2		237.8		232.1		565.6	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	76.0		35.3		-79.1		-54.7		-294.1	
i. Pactadas	569.1		447.7		545.4		507.7		238.7	
ii. Vencidas	493.2		411.4		624.5		417.4		532.8	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	424.3		610.6		502.3		492.6		349.7	
ii. Forwards	0.0		0.0		29.0		0.0		150.0	
e. Operaciones asociadas a swaps vencimientos de forwards sin entrega	91.5		384.4		267.5		437.1		437.1	
Compras	188.0		615.8		321.1		331.1		498.8	
ii. Ventas	129.6		211.4		196.0		144.0		502.2	
f. Efecto de Opciones	0.0		0.6		-0.1		0.5		20.3	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-31.7		-32.6		51.3		117.7		-1.8	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.4629		3.4851		3.4742		3.4944		3.5123	
(*) Datos preliminares										