BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	20 Jul 20	21 Jul 20	22 Jul 20	23 Jul 20	24 Jul 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**13,937.3**	**13,739.6**	**13,652.7**	**13,160.3**	**15,088.0**
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)	Desierta 300.0	Desierta 500.0	Desierta 300.0	26.0	100.0
Propuestas recibidas	139.0 533.0	139.0 914.0	125.0 386.0	26.0	118.5
Plazo de vencimiento	351 d 31 d	350 d 30 d	349 d 29 d	28 d	34 d
Tasas de interés: Mínima	- 0.24	- 0.24	- 0.24	0.24	0.24
Máxima	- 0.25	- 0.25	- 0.25	0.25	0.24
Promedio	- 0.25	- 0.25	- 0.24	0.25	0.24
Saldo	32,197.0	31,540.0	31,893.0	31,919.0	31,619.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 30 de Julio del 2020	1,457.0	400.0	400.0	400.0	500.0
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 31 de Julio del 2020	1,857.0	400.0	400.0	900.0	500.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	15,352.0	14,752.0	14,752.0	14,752.0	14,752.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Julio del 2020	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Repo Valores del 27 al 31 de Julio del 2020	0.0	0.0	0.0	300.0	300.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera 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 27 al 31 de Julio del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	250.0	250.0	293.6	143.6	143.6
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 18 de Noviembre del 2020	150.0	150.0	150.0	100.0	100.0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 27 al 31 de Julio del 2020	150.0	150.0	150.0	0.0	0.0
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)		Desierta 72.0			
Garantía para los créditos		95% 90%			
Propuestas recibidas		72.0			
Plazo de vencimiento		d 1094 d 1094 d			
Tasas de interés: Mínima		- 1.99			
Máxima		- 1.99			
Promedio		- 1.99			
Saldo adjudicado	49,191.6	49,266.6	49,266.6	49,266.6	49,266.6
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)		Desierta			
Garantía para los créditos		98%			
Propuestas recibidas		-			
Plazo de vencimiento		1094 d			
Tasas de interés: Mínima		-			
Máxima		-			
Promedio		-			
Saldo adjudicado	1,349.2	1,349.2	1,349.2	1,349.2	1,349.2
vii. Subasta de Compra 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 27 al 31 de Julio 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 27 al 31 de Julio 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 27 al 31 de Julio del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.0 7 800.0	3 500.1 7 249.5	2 050.3 6 600.1	1 310.5 3 595.4	2 448.2 9 218.7
Propuestas recibidas	3 505.3 8 336.8	3 939.5 7 249.5	2 050.3 8 379.6	1 310.5 3 595.4	2 448.2 9 218.7
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	8 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	0.23 0.22	0.23 0.22	0.23 0.22	0.23 0.22	0.23 0.22
Máxima	0.25 0.24	0.25 0.24	0.25 0.24	0.25 0.25	0.25 0.25
Promedio	0.24 0.23	0.24 0.24	0.25 0.23	0.25 0.23	0.25 0.23
Saldo	11,274.8	22,024.5	20,425.4	16,456.1	21,527.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Julio del 2020	2,999.9	10,249.5	8,875.2	6,595.2	12,218.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 31 de Julio del 2020	11,274.8	15,524.4	11,875.0	16,456.1	21,527.8
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3,000.1	3,000.1	3,000.1	2,500.1	2,500.1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 26 de Octubre del 2020	500.0	500.0	500.0	500.1	500.1
Vencimiento de Coloc-TP del 27 al 31 de Julio del 2020	500.0	500.0	500.0	0.0	0.0
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 27 al 31 de Julio del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			300.0		300.0
Propuestas recibidas			450.0		580.0
Plazo de vencimiento			62 d		62 d
Tasas de interés: Mínima			-0.25		0.0
Máxima			0.00		0.0
Promedio			-0.05		0.0
Saldo	2,390.0	2,390.0	2,390.0	2,390.0	2,640.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 11 de Agosto del 2020	300.0	300.0	50.0	50.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 27 al 31 de Julio del 2020	350.0	350.0	50.0	50.0	0.0
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 27 al 31 de Julio del 2020					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7,195.0	7,195.0	7,195.0	7,195.0	7,195.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 4 de Agosto del 2020	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de Julio del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo					
Vencimiento de REPO del 27 al 31 de Julio 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 27 al 31 de Julio 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 27 al 31 de Julio del 2020					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,252.5	1,252.5	1,252.5	1,252.5	1,252.5
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Agosto del 2020	335.0	335.0	335.0	335.0	335.0
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 31 de Julio del 2020	0.0	0.0	0.0	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 27 al 31 de Julio del 2020					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	14.3	80.4	243.5	11.0	369.7
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$)	0.0	21.6	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	21.6	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2,851.6**	**2,645.7**	**4,645.8**	**8,239.3**	**3,690.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%	0.0015%	0.0015%	0.0015%	0.0015%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,524.3	1,135.9	2,506.9	5,795.4	1,199.1
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,327.3**	**1,509.8**	**2,138.9**	**2,443.9**	**2,491.7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,824.4	9,627.0	9,537.0	9,553.7	9,485.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	5.0	4.9	4.8	4.8	4.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,861.0	3,663.2	3,573.7	3,557.6	3,514.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	1.9	1.8	1.8	1.8	1.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	156.0	116.0	65.0	70.0	115.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.20 / 0.20 / 0.24	0.20 / 0.20 / 0.24	0.15 / 0.15 / 0.24	0.15 / 0.15 / 0.25	0.15 / 0.15 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)					
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**17 Julio 20**	**20 Julio 20**	**21 Julio 20**	**22 Julio 20**	**23 Julio 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-6.6	-15.9	-94.6	-4.1	57.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	47.1	-42.0	-117.4	-85.9	-75.6
a. Mercado spot con el público	-15.4	-55.7	-129.1	-110.1	-124.0
i. Compras	247.1	183.4	207.5	256.8	214.8
ii. (-) Ventas	262.4	239.2	336.6	366.9	338.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	99.0	94.4	161.7	111.4	198.0
i. Pactadas	209.4	247.0	309.9	282.3	199.8
ii. (-) Vencidas	231.4	150.4	148.2	150.9	387.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	37.1	70.2	133.5	29.2	332.7
i. Pactadas	133.5	195.2	288.8	272.4	332.1
ii. (-) Vencidas	96.1	125.0	155.3	243.2	1132.8
d. Operaciones interbancarias					
i. Al vencimiento	177.1	174.3	222.0	349.0	300.2
ii. A futuro	20.0	50.0	10.0	70.0	40.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-76.5	-7.6	20.5	115.8	795.3
i. Compras	94.1	120.7	154.8	229.2	1131.5
ii. (-) Ventas	170.6	128.2	134.3	113.3	336.2
f. Efecto de Opciones	5.7	-0.3	-5.4	-0.4	-10.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	3.7	-4.1	-1.7	0.7	-1.9
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5141	3.5135	3.4928	3.5043	3.5209

(*) Datos preliminares

Elaborado: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera