BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	7 Set 20	8 Set 20	9 Set 20	10 Set 20	11 Set 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**28,524.9**	**30,828.8**	**30,159.9**	**28,307.4**	**27,043.3**
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)	300.0 500.0	500.0 929.7	500.1 1000.0	300.0 500.0	300.0 500.0
Propuestas recibidas	482.0 951.0	723.0 959.7	961.8 1196.0	660.8 763.5	497.0 826.0
Plazo de vencimiento	86 d 29 d	92 d 31 d	91 d 30 d	90 d 33 d	89 d 32 d
Tasas de interés: Mínima	0.26 0.25	0.27 0.24	0.27 0.24	0.26 0.24	0.26 0.24
Máxima	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.24
Promedio	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.24	0.27 0.24	0.27 0.24
Saldo	37,785.2	36,180.9	37,781.0	38,581.0	39,381.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Setiembre del 2020	3,134.0	2,000.0	2,000.0	2,000.0	2,000.0
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 18 de Set. del 2020	3,134.0	0.0	0.0	0.0	5,600.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	10,653.5	10,653.5	9,563.5	9,563.5	9,563.5
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 15 de Setiembre del 2020	1,090.0	1,090.0	80.0	80.0	80.0
Vencimiento de Reso Valores del 11 al 18 de Set. del 2020	1,090.0	1,090.0	0.0	0.0	80.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso de Cartera General					
Vencimiento de Reso de Cartera General TCCOMPRA					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas				15.9	
Plazo de vencimiento				15.9	
Tasas de interés: Mínima				1083 d	
Máxima				0.50	
Promedio				0.50	
Saldo	263.1	263.1	263.1	279.0	279.0
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 18 de Noviembre del 2020	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 11 al 18 de Set. del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)		Desierta 12,1 Desierta 10,2		36,0 87,0 Desierta 11,0	
Garantía para los créditos		98% 95% 90% 80%		98% 95% 90% 80%	
Propuestas recibidas		-,- 12,1 0,5 10,2		36,0 87,0 11,0	
Plazo de vencimiento		1095 d 1095 d 1095 d 1095 d		1096 d 1096 d 1096 d 1096 d	
Tasas de interés: Mínima		-,- 1,90 -,- 1,70		3,98 1,90 -,- 1,90	
Máxima		-,- 2,00 -,- 2,05		5,00 2,50 -,- 1,90	
Promedio		-,- 1,96 -,- 1,78		4,29 1,97 -,- 1,90	
Saldo adjudicado	52,793.0	52,815.3	52,815.3	52,949.3	52,949.3
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)		Desierta		Desierta	
Garantía para los créditos		98%		98%	
Propuestas recibidas		120,0		120,0	
Plazo de vencimiento		1095 d		1096 d	
Tasas de interés: Mínima		-,-		-,-	
Máxima		-,-		-,-	
Promedio		-,-		-,-	
Saldo adjudicado	1,851.1	1,851.1	1,851.1	1,851.1	1,851.1
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 Reso Especial - CDR del 11 al 18 de Set. 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 11 al 18 de Set. 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 11 al 18 de Set. del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 403,8 15 934,2	2 198,0 5 736,7	3 885,9 16 161,0	3 333,8 15 829,0	2 500,0 15 674,5
Propuestas recibidas	2 403,8 15 934,2	2 198,0 5 736,7	3 885,9 16 161,0	3 333,8 15 829,0	2 622,7 15 674,5
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	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 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	0,25 0,25	0,25 0,25	0,25 0,25
Saldo	30,365.7	19,866.1	30,834.3	30,150.6	29,996.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Setiembre del 2020	18,434.3	9,078.7	19,846.5	18,329.1	18,078.3
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 18 de Set. del 2020	27,961.9	15,264.3	22,346.6	18,329.1	29,996.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,500.1	2,500.1	2,500.1	2,500.1	2,500.1
Próximo vencimiento de Coloc.-TP el 26 de Octubre del 2020	500.1	500.1	500.1	500.1	500.1
Vencimiento de Coloc.-TP del 11 al 18 de Set. del 2020	0.0	0.0	0.0	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 11 al 18 de Set. del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		200.0	190.0	200.0	130.0
Propuestas recibidas		575,0	190,0	454.0	130.0
Plazo de vencimiento		91 d	91 d	91 d	95 d
Tasas de interés: Mínima		-0.01	0.14	-0.07	-0.05
Máxima		0,07	0,25	0,00	0,20
Promedio		0,02	0,19	-0,06	0,10
Saldo	3,210.0	3,210.0	3,400.0	3,600.0	3,730.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de Setiembre del 2020	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 18 de Set. del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	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 11 al 18 de Set. del 2020					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6,595.0	6,595.0	6,595.0	6,595.0	6,595.0
Próximo vencimiento de Reso Regular el 16 de Setiembre del 2020	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de REPO del 11 al 18 de Set. del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	500.0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 11 al 18 de Set. 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 Reso Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 11 al 18 de Set. 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 Reso Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 18 de Set. del 2020					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				200,0	200,0 500,0
Propuestas recibidas				360.0	685.0 685.0
Plazo de vencimiento				91 d	91 d 94 d
Tasas de interés: Mínima				-0.20	-0,35 -0,40
Máxima				0.10	-0,25 0.05
Promedio				-0,08	-0,30 -0,15
Saldo	3,375.2	3,375.2	3,375.2	3,575.2	4,075.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 11 de Setiembre del 2020	200.0	200.0	200.0	200.0	50.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 18 de Set. del 2020	200.0	200.0	200.0	200.0	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 11 al 18 de Set. del 2020					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021	128.7	9.6	48.9	87.1	165.3
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$)	0.0	9.6	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	9.6	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**9,515.6**	**21,474.0**	**8,471.8**	**8,219.0**	**8,104.1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%	0.0015%	0.0015%	0.0015%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	6,067.2	17,731.0	5,362.9	6,187.2	5,948.8
Tasa de interés	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,448.4**	**3,743.0**	**3,108.9**	**2,031.8**	**2,156.3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,408.8	10,229.0	10,212.4	10,046.7	9,776.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.1	5.0	5.0	4.9	4.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,286.4	4,102.4	4,095.2	3,933.2	3,662.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.1	2.0	2.0	1.9	1.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	55.0	257.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés : Mínima / Máxima / TIBO	0.15/ 0.20 / 0.25	0.05/ 0.15 / 0.09	0.22/ 0.22 / 0.22	0.21/ 0.21 / 0.21	0.25/ 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	55.0	0.0	0.0	15.0
Tasas de interés : Mínima / Máxima/ Promedio		0.05/ 0.25 / 0.09			
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	70.0	15.0	0.0	0.0
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$)	**04 Setiembre 20**	**07 Setiembre 20**	**08 Setiembre 20**	**09 Setiembre 20**	**10 Setiembre 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	7.3	-72.2	-6.0	19.1	172.1
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + f	-80.3	-110.7	-86.7	-31.3	63.6
a. Mercado spot con el público	-91.5	-113.8	-121.0	-114.0	-36.3
i. Compras	188.1	158.0	201.1	223.0	292.4
ii. (-) Ventas	279.6	271.8	322.0	337.0	328.8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	182.8	49.1	83.9	-21.1	-122.0
i. Pactadas	432.1	77.0	300.9	211.2	255.9
ii. (-) Vencidas	249.2	27.9	217.0	232.3	377.9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	95.7	9.8	2.8	-71.0	-174.5
i. Pactadas	222.8	19.5	467.2	268.2	734.8
ii. (-) Vencidas	127.1	9.7	464.4	339.2	909.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	360.8	192.0	378.8	358.5	390.7
ii. A futuro	60.0	0.0	0.0	3.0	28.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-101.5	-14.4	298.7	133.6	560.6
i. Compras	125.3	3.6	454.4	332.3	908.4
ii. (-) Ventas	226.8	18.1	165.7	198.7	347.8
f. Pago de Dividendos	9.6	-0.8	0.6	0.6	9.7
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-12.5	-0.6	-7.1	56.0	117.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5526	3.5356	3.5432	3.5367	3.5433

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera