BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	14 Set 20	15 Set 20	16 Set 20	17 Set 20	18 Set 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**27,849.9**	**27,990.7**	**28,057.5**	**28,593.4**	**24,556.4**
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)	500.0 999.9	500.0 1000.0	300.0 270.0	300.0 389.2	300.0 306.1
Propuestas recibidas	575.7 1720.0	580.5 1555.0	330.0 270.0	512.0 419.2	658.0 306.1
Plazo de vencimiento	92 d 29 d	91 d 30 d	90 d 29 d	89 d 28 d	88 d 27 d
Tasas de interés: Mínima	0.24 0.24	0.24 0.24	0.24 0.24	0.26 0.24	0.26 0.25
Máxima	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.25
Promedio	0.27 0.24	0.27 0.24	0.27 0.25	0.27 0.25	0.27 0.25
Saldo	38,880.9	38,280.9	38,850.9	38,850.9	38,736.2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 21 de Setiembre del 2020	2.100.0	1.500.0	1.500.0	1.500.0	1.975.0
Vencimiento de CD BCRP del 17 al 18 de Set. del 2020	3,600.0	1,500.0	1,500.0	1,500.0	3,275.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9,563.5	9,483.5	9,483.5	9,483.5	9,483.5
Próximo vencimiento de Reoo de Valores el 21 de Setiembre del 2020	80.0	80.0	80.0	80.0	80.0
Vencimiento de Reno Valores del 17 al 18 de Set. del 2020	80.0	0.0	0.0	0.0	280.0
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 Reoo de Cartera General					
Vencimiento de Reoo de Cartera General TCCOMPRA					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	279.0	298.2	301.8	301.8	301.8
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 18 de Noviembre del 2020	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Reoo de Cartera Alternativo del 17 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 Desierta Desierta Desierta		20,0 10,5 2,2 Desierta	
Garantía para los créditos		98% 95% 90% 80%		98% 95% 90% 80%	
Propuestas recibidas		10.0 -.- -.- -.-		20.0 10.5 2.2 -.-	
Plazo de vencimiento		1095 d 1095 d 1095 d 1095 d		1095 d 1095 d 1095 d 1095 d	
Tasas de interés: Mínima		-.- -.- -.- -.-		3,99 2,00 2,25 -.-	
Máxima		-.- -.- -.- -.-		3,99 2,15 2,25 -.-	
Promedio		-.- -.- -.- -.-		3,99 2,01 2,25 -.-	
Saldo adjudicado	52,949.3	52,957.3	52,957.3	52,957.3	52,990.0
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		1095 d	
Tasas de interés: Mínima		-.-			
Máxima		-.-			
Promedio		-.-			
Saldo adjudicado	1.851.1	1.853.1	1.853.1	1.853.1	1.853.1
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 Reoo Especial - CDR del 17 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 17 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 17 al 18 de Set. del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 368,0 15 169,1	2 000,0 17 028,2	4 000,1 15 988,4	3 338,2 16 276,5	2 414,7 16 410,0
Propuestas recibidas	2 368,0 15 169,1	2 838,5 17 028,2	4 415,9 15 988,4	3 338,2 16 276,5	2 414,7 16 410,0
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 0.23	0.24 0.24	0.24 0.24	0.24 0.23	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	29,454.8	31,115.9	30,190.3	30,190.3	30,531.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de Setiembre del 2020	17,367.1	20,914.1	19,322.2	19,322.2	18,778.0
Vencimiento de Deoósitos a Plazo del 17 al 18 de Set. del 2020	27.086.8	26.747.9	21.822.2	21.822.2	30.531.0
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 17 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 17 al 18 de Set. del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Deoósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3.730.0	3.730.0	3.730.0	3.730.0	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 17 al 18 de Set. del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	600.0
xiv. Subasta de Certificados de Deoósitos del BCR con Neoociación Restrinoida (CDBCRP-NR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 17 al 18 de Set. del 2020					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Reoular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6.595.0	6.595.0	6.095.0	6.095.0	6.107.7
Próximo vencimiento de Repo Regular el 30 de Setiembre del 2020	500.0	500.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REPO del 17 al 18 de Set. del 2020	500.0	500.0	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 Reoo					
Vencimiento de REPO del 17 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 Reoo Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 17 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 Reoo Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 17 al 18 de Set. del 2020					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4.075.2	4.075.2	4.075.2	4.075.2	4.075.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Setiembre del 2020	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de SC - Venta del 17 al 18 de Set. del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimient Mínima					
Tasas de interés: Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 17 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	34.5	207.4	101.6	64.7	0.6
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neoociación 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$)	2.2	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	2.2	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8,847.4**	**7,685.2**	**7,603.1**	**8,354.2**	**7,326.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%	0.0015%	0.0015%	0.0015%	0.0015%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Deoósitos Overnioht en moneda nacional	6.802.9	5.962.8	6.081.5	6.771.0	5.992.9
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,044.5**	**1,722.4**	**1,521.6**	**1,583.2**	**1,333.3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9.454.9	9.373.8	9.257.1	9.149.7	9.071.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.6	4.8	4.5	4.5	4.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3.348.3	3.254.0	3.138.1	3.031.2	2.954.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.6	1.6	1.5	1.5	1.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	68.0	0.1	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25/ 0.25 / 0.25	0.25/ 0.25 / 0.25	0.25/ 0.25 / 0.25	0.25/ 0.25 / 0.25	0.25/ 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.1	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio			0.08/ 0.08 / 0.08		
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	100.0	8.4	45.0	110.0	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$)	**11 Setiembre 20**	**14 Setiembre 20**	**15 Setiembre 20**	**16 Setiembre 20**	**17 Setiembre 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-28.7	132.5	-153.8	12.3	30.9
Flujo de la posición contable = a + b.i + c.i + e + f	-3.8	-71.8	-84.6	-158.0	-91.3
a. Mercado spot con el público	-77.6	-142.4	-112.4	-181.6	-113.7
i. Compras	302.6	226.7	225.5	178.1	327.7
ii. (-) Ventas	380.2	369.1	337.9	359.7	441.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	286.2	23.3	-82.1	47.5	-38.9
i. Pactadas	363.9	363.2	191.8	348.4	426.8
ii. (-) Vencidas	77.7	339.9	273.9	300.9	465.7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	435.2	-180.4	-16.4	-118.6	-162.5
i. Pactadas	510.4	410.9	480.0	335.1	442.8
ii. (-) Vencidas	75.2	591.3	496.4	453.7	605.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	316.3	483.6	279.1	311.0	336.5
ii. A futuro	73.0	65.0	53.0	30.0	10.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	33.6	320.7	252.9	177.1	171.3
i. Compras	64.9	589.6	485.0	453.6	603.9
ii. (-) Ventas	31.3	269.0	232.0	276.5	432.6
f. Pago de Opciones	-14.0	0.6	-3.5	4.7	-1.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	175.7	1.4	-2.6	-0.7	-9.2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5720	3.5673	3.5496	3.5390	3.5336

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera