BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	12 Oct 20	13 Oct 20	14 Oct 20	15 Oct 20	16 Oct 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**29 172,8**	**30 218,1**	**30 284,0**	**30 535,6**	**30 117,9**
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 BCR)	300.0 500.0	300.0 700.0	300.0 700.0	300.0 700.1	117.0 700.0
Propuestas recibidas	420.0 763.0	406.0 1417.0	372.7 869.0	357.0 1220.0	117.0 927.0
Plazo de vencimiento	92 d 31 d	91 d 30 d	90 d 29 d	89 d 32 d	88 d 31 d
Tasas de interés: Mínima	0.27 0.23	0.26 0.23	0.27 0.23	0.27 0.23	0.27 0.23
Máxima	0.28 0.24	0.28 0.24	0.28 0.24	0.28 0.24	0.28 0.25
Promedio	0.28 0.24	0.28 0.23	0.28 0.23	0.28 0.24	0.28 0.24
Saldo	37 673.9	36 674.0	37 674.0	36 708.8	37 525.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 23 de Octubre del 2020	1 999.9		1 965.3		459.0
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 23 de Oct. del 2020	3 965.2		1 965.3		459.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 143.5	5 963.5	5 958.5	5 958.5	5 958.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 23 de Octubre del 2020	180.0		200.0		200.0
Vencimiento de Repo Valores del 19 al 23 de Oct. del 2020	185.0		0.0		200.0
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 Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo 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	355.9	355.9	355.9	355.9	355.9
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 18 de Noviembre del 2020	100.0		100.0		100.0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 19 al 23 de Oct. del 2020	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)		3.0 7.0 0.3 Desierta		67.0 19.0 Desierta Desierta	
Garantía para los créditos		98% 95% 90% 80%		98% 95% 90% 80%	
Propuestas recibidas		3.0 7.0 0.3 -.-		67.0 19.0 -.- -.-	
Plazo de vencimiento		1095 d 1095 d 1095 d 1095 d		1096 d 1096 d 1096 d 1096 d	
Tasas de interés: Mínima		3.90 1.90 2.25 -.-		3.80 2.00 -.- -.-	
Máxima		3.90 1.90 2.25 -.-		5.25 3.25 -.- -.-	
Promedio		3.90 1.90 2.25 -.-		4.09 2.85 -.- -.-	
Saldo adjudicado	53 284.5	53 294.8	53 294.8	53 380.8	53 380.8
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)		3.0		2.0	
Garantía para los créditos		98%		98%	
Propuestas recibidas		3.0		2.0	
Plazo de vencimiento		1095 d		1096 d	
Tasas de interés: Mínima		3.90		4.00	
Máxima		3.90		5.25	
Promedio		3.90		4.63	
Saldo adjudicado	1 876.7	1 879.7	1 879.7	1 881.7	1 881.7
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 19 al 23 de Oct. 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 19 al 23 de Oct. 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 19 al 23 de Oct. del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 500.0 16 510.3	2 999.9 18 825.1	3 551.3 17 376.5	3 000.2 17 548.9	4 000.1 17 994.4
Propuestas recibidas	3 896.8 16 510.3	3 368.8 18 825.1	3 551.3 17 376.5	3 940.5 17 548.9	4 332.9 17 994.4
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	0.23 0.23	0.24 0.24	0.23 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	33 156.3	35 325.2	33 927.9	34 100.5	35 045.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de Octubre del 2020	19 656.1		20 376.5		21 494.4
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 19 al 23 de Oct. del 2020	29 656.3		23 876.7		35 045.9
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
Vencimiento de Coloc-TP del 19 al 23 de Oct. del 2020	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 19 al 23 de Oct. del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	Desierta		300.0		
Propuestas recibidas	0.0		565.0		
Plazo de vencimiento	92 d		92 d		
Tasas de interés: Mínima	-.-		0.00		
Máxima	-.-		0.00		
Promedio	-.-		0.00		
Saldo	6 125.0	5 925.0	6 225.0	6 225.0	6 225.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 21 de Octubre del 2020	200.0		90.0		90.0
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 23 de Oct. del 2020	200.0		0.0		90.0
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 19 al 23 de Oct. del 2020					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 695.0	5 695.0	5 695.0	5 695.0	5 695.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Febrero del 2021	500.0		500.0		500.0
Vencimiento de REPO del 19 al 23 de Oct. del 2020	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 19 al 23 de Oct. 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 Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 19 al 23 de Oct. 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 Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 19 al 23 de Oct. del 2020					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		Desierta	200.0		
Propuestas recibidas		0.0	349.0		
Plazo de vencimiento		92 d	92 d		
Tasas de interés: Mínima		-.-	0.05		
Máxima		-.-	0.22		
Promedio		-.-	0.12		
Saldo	5 012.8	4 562.8	4 162.8	4 162.8	4 162.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 21 de Octubre del 2020	450.0		190.0		190.0
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 23 de Oct. del 2020	1 050.0		0.0		190.0
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 19 al 23 de Oct. del 2020					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 002	0.0	49.1	52.4	30.5	4.8
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$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	10.1	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	10.1	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8 362.5**	**7 442.2**	**8 103.6**	**9 016.9**	**7 311.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5 464.6	5 341.7	5 333.2	5 980.5	5 175.4
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 897.9**	**2 100.5**	**2 770.4**	**3 036.4**	**2 135.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 700.4	9 624.7	9 530.0	9 557.9	9 539.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.8	4.7	4.7	4.7	4.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 546.5	3 465.2	3 367.7	3 390.3	3 368.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.7	1.7	1.6	1.7	1.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	85.0	0.0	0.0	102.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	108.0	153.0	138.0	118.0	158.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	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
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	75.0	170.0	0.0	250.0	80.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					30.0 / 0.34
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**09 Octubre 20**	**12 Octubre 20**	**13 Octubre 20**	**14 Octubre 20**	**15 Octubre 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-60,5	26,5	-24,8	68,6	22,7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-79.8	-14.6	-45.4	99.3	-20.9
a. Mercado spot con el público	-134.5	-50.5	-6.0	-41.0	-36.1
i. Compras	144.4	176.3	262.4	277.2	250.5
ii. (-) Ventas	278.9	226.8	268.4	318.2	286.5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-56.1	39.3	44.9	-201.1	-205.4
i. Pactadas	326.6	79.0	485.9	235.3	175.8
ii. (-) Vencidas	382.7	39.7	441.0	436.4	381.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-31.5	-1.0	-88.4	-282.2	-251.4
i. Pactadas	313.3	7.4	371.8	242.5	160.5
ii. (-) Vencidas	344.8	8.4	460.2	524.6	411.9
d.. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	622.6	219.9	356.3	407.1	276.6
ii. A futuro	0.0	0.0	127.0	130.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	17.2	2.7	46.1	142.3	51.7
i. Compras	342.0	7.7	452.6	524.4	405.1
ii. (-) Ventas	324.7	5.0	406.5	382.1	353.4
f. Efecto de Opciones	43.9	0.8	13.3	0.3	-2.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.5	2.0	-192.3	-25.9	-5.9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,5700	3,5882	3,5945	3,5884	3,5862
(*) Datos preliminares					

<u>Elaboración:</u> Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera