BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	7 Dic 20		9 Dic 20		10 Dic 20		11 Dic 20	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**29,254.4**		**34,456.1**		**35,055.8**		**34,204.3**	
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)	131.0	10.0	1000.0	380.0	300.0	600.0	300.0	300.0
Posturas recibidas	171.0	30.0	1147.5	400.0	736.5	909.0	440.0	327.7
Plazo de vencimiento	95 d	28 d	93 d	34 d	92 d	33 d	91 d	32 d
Tasas de interés: Mínima	0.28	0.25	0.27	0.25	0.28	0.24	0.27	0.25
Máxima	0.28	0.25	0.28	0.25	0.28	0.25	0.28	0.25
Promedio	0.28	0.25	0.28	0.25	0.28	0.25	0.28	0.25
Saldo	39.992.8		39.632.7		38.662.7		39.272.7	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Diciembre del 2020	1.800.1		2.000.0		2.240.0		2.240.0	
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de Dic. de 2020	3.800.1		2.000.0		0.0		4.017.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	5.058.5		5.058.5		5.058.5		5.058.5	
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 23 de Marzo del 2021	200.0		200.0		200.0		200.0	
Vencimiento de Reso Valores del 14 al 18 de Dic. de 2020	0.0		0.0		0.0		0.0	
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)								
Posturas 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)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	282.2		282.2		282.2		282.2	
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 18 de Enero del 2021	6.8		6.8		6.8		6.8	
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 14 al 18 de Dic. de 2020	0.0		0.0		0.0		0.0	
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)								
Garantía para los créditos								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo adjudicado	63.900.6		63.900.6		63.900.6		63.900.6	
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)								
Garantía para los créditos								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo adjudicado	1.882.2		1.882.2		1.882.2		1.882.2	
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR								
Vencimiento de Reso Especial - CDR del 14 al 18 de Dic. de 2020								
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de CDV BCRP								
Vencimientos de CDV BCRP del 14 al 18 de Dic. de 2020								
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de CDLD BCRP								
Vencimiento de CDLD BCRP del 14 al 18 de Dic. de 2020								
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 000.1	14 786.5	4 500.0	17 408.3	3 999.9	17 890.0	3 999.9	17 561.4
Posturas recibidas	3 928.0	14 786.5	4 820.0	17 408.3	4 710.7	17 890.0	4 121.5	17 561.4
Plazo de vencimiento	7 d	2 d	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	0.24	0.20	0.24	0.24	0.24	0.24	0.24	0.24
Máxima	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
Saldo	31.027.3		31.906.2		32.887.7		33.061.3	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Diciembre del 2020	21.029.4		20.908.4		21.387.7		20.561.5	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de Dic. de 2020	28.027.2		24.406.1		21.387.7		33.061.3	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	700.0		700.0		700.0		700.0	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 23 de Diciembre del 2020	500.0		500.0		500.0		500.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 14 al 18 de Dic. de 2020	0.0		0.0		0.0		0.0	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de Coloc-BN								
Vencimiento de Coloc - BN del 14 al 18 de Dic. de 2020								
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	7.125.0		6.935.0		6.735.0		6.735.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 de Diciembre del 2020	190.0		200.0		130.0		130.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 18 de Dic. de 2020	390.0		200.0		0.0		130.0	
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR								
Vencimientos de CD BCRP del 14 al 18 de Dic. de 2020								
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	5.970.0		5.970.0		5.970.0		5.970.0	
Próximo vencimiento de Reso Regular el 3 de Febrero del 2021	500.0		500.0		500.0		500.0	
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de Dic. de 2020	0.0		0.0		0.0		0.0	
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de Reso								
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de Dic. de 2020								
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Ampliación)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de Reso Extension								
Vencimiento de REPO Expansión del 14 al 18 de Dic. de 2020								
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de Reso Sustitucion								
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 18 de Dic. de 2020								
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	Desierta	Desierta						
Posturas recibidas	10.0	15.0						
Plazo de vencimiento	182 d	91 d						
Tasas de interés: Mínima	0.00	0.00						
Máxima	n.m.	n.m.						
Promedio	n.m.	n.m.						
Saldo	9.794.7		9.794.7		9.194.7		7.994.7	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 14 de Diciembre del 2020	200.0		200.0		200.0		500.0	
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de Dic. de 2020	400.0		400.0		200.0		500.0	
xx. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP								
Posturas recibidas								
Plazo de vencimiento	Mínima							
Tasas de interés: Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de SC-Compra								
Vencimiento de SC - Compra del 14 al 18 de Dic. de 2020								
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP. Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021	7.0		15.3		128.2		214.6	
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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$)	0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)								
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y RTP								
i. Compras de CD BCRP, o CD BCRP-NR								
ii. Compras de RTP								
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**11.333.8**		**11.183.1**		**12.394.1**		**12.257.6**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones								
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).								
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0007%		0.0014%		0.0014%		0.0014%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)								
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional								
Tasa de interés								
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	8.441.0		7.783.6		8.486.5		9.073.5	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,892.8**		**3,399.5**		**3,907.6**		**3,184.1**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10.697.0		10.411.8		10.243.9		10.278.8	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.2		5.1		5.0		5.0	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4.542.4		4.246.7		4.077.2		4.108.0	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.2		2.1		2.0		2.0	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP								
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		0.0		0.0	
Tasas de interés. Mínima / Máxima / TIBO	- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	437.5		403.0		184.0		406.0	
Tasas de interés. Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.30 / 0.31		0.30 / 0.50 / 0.38		0.30 / 0.50 / 0.47		0.25 / 0.30 / 0.26	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	80.0		129.0		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 Diciembre 20**		**07 Diciembre 20**		**09 Diciembre 20**		**10 Diciembre 20**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-106.6		99.1		37.4		-17.1	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-59.5		61.8		58.3		-108.7	
a. Mercado spot con público	47.7		47.7		47.7		76.4	
i. Compras	349.9		328.9		506.0		389.1	
ii. Ventas	386.9		247.1		458.2		428.5	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-174.3		-191.7		165.9		-120.0	
i. Pactadas	298.1		142.6		307.1		291.2	
ii. Vencidas	472.3		334.3		141.2		411.2	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-137.0		-158.5		141.1		-262.0	
i. Pactadas	59.8		72.6		361.6		197.7	
ii. Vencidas	196.8		232.1		220.4		459.7	
d. Operaciones cambiarias interbancarias								
i. Al contado	379.8		356.9		359.9		345.0	
ii. A futuro	0.0		30.0		138.0		198.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-251.3		-61.9		48.7		42.3	
i. Compras	185.8		228.6		174.9		434.6	
ii. Ventas	437.1		291.5		126.2		392.1	
f. Efecto de Opciones	n.m.		n.m.		n.m.		n.m.	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-54.7		0.6		-53.7		-113.7	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera								
Tasa de interés								
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5809		3.6028		3.6022		3.6006	
(*) Data preliminar								

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera