

**BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU**

**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**

(Millones de Soles)

	9 Mar 20	10 Mar 20	11 Mar 20	12 Mar 20	13 Mar 20
<b>1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP</b>	<b>3,037.6</b>	<b>2,819.9</b>	<b>2,688.2</b>	<b>2,917.9</b>	<b>2,842.6</b>
<b>2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones</b>					
<b>a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR</b>					
<b>i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)</b>					
Propuestas recibidas	-30.0	30.0	30.0	-30.0	0.0
Plazo de vencimiento	143.5	177.0	79.0	49.6	49.6
Tasas de interés	178.4	327.4	722.4	1086.6	1086.6
Tasas de interMinima	2.05	2.08	2.15	2.25	2.25
Máxima	2.10	2.10	2.21	2.30	2.30
Promedio	2.07	2.09	2.19	2.27	2.27
Saldo	28,334.8	28,334.8	28,334.8	28,334.8	28,334.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de abril de 2020	1,800.0	1,800.0	1,800.0	1,800.0	1,800.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>ii. Subasta de Certificados de Depósitos de Valores (REDO)</b>					
Propuestas recibidas	1,800.0	1,200.0	800.0	200.0	300.0
Plazo de vencimiento	2,200.0	2,100.0	1,100.0	200.0	300.0
Tasas de interés	1.4	1.4	1.4	1.4	1.4
Tasas de interMinima	2.51	2.46	2.55	2.46	2.36
Máxima	2.51	2.57	2.62	2.46	2.36
Promedio	2.51	2.52	2.59	2.46	2.36
Saldo	6,750.0	6,150.0	5,350.0	4,650.0	4,750.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 16 de marzo de 2020	1,800.0	1,700.0	900.0	200.0	300.0
Vencimiento de Repo Valores del 16 al 20 de marzo del 2020	2,300.0	1,700.0	900.0	200.0	300.0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>ii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>iii. Subasta de Subrogación de Depósitos de Recurso del BCRP (CDR BCRP)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,100.2	4,100.2	4,100.2	4,100.2	4,100.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 25 de junio de 2020	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>iv. Subasta de Certificados de Depósitos de Recurso del BCRP (CDR BCRP)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>v. Compra con contrapartido de Recurso de moneda extranjera (Regular)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9,250.0	9,250.0	9,250.0	9,250.0	9,250.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 20 de marzo de 2020	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	400.0	400.0
<b>vi. Compra con contrapartido de Recurso de moneda extranjera (Expansión)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>vii. Compra con contrapartido de Recurso de moneda extranjera (Sustitución)</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>300.0</b>	<b>300.0</b>	<b>300.0</b>	<b>300.0</b>	<b>300.0</b>
<b>a. Subasta de Santa Catalina/Venta del BCRP</b>					
Propuestas recibidas	75.0	115.0	78.0	44.0	37.0
Plazo de vencimiento	63.4	63.4	52.4	64.4	52.4
Tasas de interés	0.70	-0.40	-0.30	0.10	-0.20
Máxima	0.95	0.00	0.00	1.05	1.05
Promedio	0.87	-0.18	-0.05	0.11	-0.12
Saldo	3,525.7	3,525.7	3,525.7	3,525.8	3,525.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de marzo de 2020	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>b. Subasta de Santa Catalina/Compra del BCRP</b>					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 16 al 20 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
<b>b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR</b>					
<b>i. Compras (millones de US\$)</b>					
Tipo de cambio promedio					
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	9.7	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	9.7	0.0	0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-AR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-AR					
ii. Compras de BTP					
<b>3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones</b>	<b>4,307.6</b>	<b>3,889.9</b>	<b>3,588.2</b>	<b>3,087.9</b>	<b>3,142.6</b>
<b>4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones</b>					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)	0.0072%	0.0072%	0.0072%	0.0071%	0.0061%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tipo de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	150.0	20.0	200.0	163.2	105.0
Tipo de interés	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
<b>5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones</b>	<b>4,187.6</b>	<b>3,889.9</b>	<b>3,588.2</b>	<b>3,087.9</b>	<b>3,142.6</b>
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	9,810.6	9,838.4	9,810.9	9,542.5	9,597.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.9	5.9	5.9	5.7	5.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,049.4	4,072.5	4,046.1	3,937.8	3,828.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.4	2.4	2.4	2.4	2.3
<b>6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP</b>					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,265.6	1,245.1	1,212.2	1,188.6	1,188.6
Tasas de interés: Minima /Maxima / Promedio	2,252,252,25	2,252,252,25	2,252,252,25	2,252,252,25	2,252,252,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	43.0	32.0	48.0	24.0	11.0
Tasas de interés: Minima /Maxima / Promedio	1,251,251,25	1,251,251,25	1,251,251,25	1,251,251,25	1,251,251,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-AR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
<b>7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)</b>	<b>06 Marzo 20</b>	<b>09 Marzo 20</b>	<b>10 Marzo 20</b>	<b>11 Marzo 20</b>	<b>12 Marzo 20</b>
Flujo de la posición (BOP) = a + b1 - c1 + e - f + g	37.6	120.5	-76.1	-43.3	29.7
Flujo de la posición corriente = a + b1 - c1 + e + f + g	46.3	-29.2	-62.3	-62.3	-121.7
a. Mercado spot con el público	38.8	-31.7	-51.7	-35.8	30.0
i. Compras	444.4	496.7	415.2	376.3	300.0
ii. (i) Ventas	425.9	528.4	487.2	460.7	445.2
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	142.5	142.5	142.5	142.5	142.5
i. (i) Ventas	87.5	187.5	217.4	178.6	120.2
ii. (i) Ventas	232.5	187.5	31.6	446.0	324.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	30.5	189.3	-165.3	162.8	222.1
i. (i) Ventas	624.7	637.7	592.1	550.0	521.2
ii. (i) Ventas	367.9	449.4	418.4	256.1	849.8
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	520.2	707.5	712.3	725.9	1000.7
ii. A futuro	164.0	127.0	151.0	124.0	30.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	183.2	266.1	87.8	38.0	38.0
i. Compras	443.2	443.2	360.4	254.4	822.3
ii. (i) Ventas	199.9	177.8	332.5	274.7	442.5
f. Efecto de Opciones	1.4	11.6	0.0	6.8	6.8
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	113.7	252.6	-11.6	256.3	411.7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tipo de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.4755	3.5054	3.4967	3.5097	3.5476
(*) Datos preliminares					