BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	08 Jun 20	09 Jun 20	10 Jun 20	11 Jun 20	12 Jun 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**16,552.4**	**16,782.8**	**16,500.6**	**16,721.6**	**17,528.2**
2. Operaciones monetarias vcambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones de Estabilización de Liquidez del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					
Propuestas recibidas	64.0	100.0 200.0	66.0 200.0	100.0 300.0	18.0 117.5
Plazo de vencimiento	64.0	206.5 407.0	135.0 415.0	247.0 495.0	26.0 317.5
Tasas de interés: Mínima	29 d	177 d 28 d	176 d 27 d	175 d 33 d	356 d 32 d
Máxima	0.25	0.34 0.24	0.35 0.25	0.35 0.24	0.45 0.24
Promedio	0.25	0.35 0.25	0.35 0.25	0.35 0.25	0.45 0.25
Saldo	28,927.9	29,227.9	29,493.9	29,893.9	30,032.6
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Junio del 2020	650.0	650.0	650.0	650.0	650.0
Vencimiento de CD BCRP del 15 al 19 de Junio del 2020	0.0	0.0	0.0	1,600.0	1,600.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14,622.0	14,747.0	14,747.0	15,537.0	15,537.0
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 16 de Junio del 2020	300.0	300.0	300.0	100.0	100.0
Vencimiento de Reso Valores del 15 al 19 de Junio del 2020	300.0	300.0	300.0	100.0	100.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0
Próximo vencimiento de Reso de Cartera General el 14 de Agosto del 2020	10.0	10.0	10.0	10.0	10.0
Vencimiento de Reso de Cartera General del 15 al 19 de Junio del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	250.0	250.0	250.0	250.0	250.0
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 15 de Julio del 2020	150.0	150.0	150.0	150.0	150.0
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 15 al 19 de Junio 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)			100.0 500.0 1,200.0 200.0	358.8	
Garantía para los créditos			80% 90% 95% 98%	98%	
Propuestas recibidas			182.0 1604.4 2608.0 992.1	1610.4	
Plazo de vencimiento			1094 d 1094 d 1094 d 1094 d	1094 d	
Tasas de interés: Mínima			1.24 1.05 0.60 0.55	0.55	
Máxima			1.49 1.90 1.88 0.95	0.74	
Promedio			1.39 1.26 1.54 0.79	0.69	
Saldo adjudicado	27,437.1	27,437.1	29,437.1	29,795.9	29,795.9
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (General)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	204.1	204.1	204.1	204.1	204.1
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 DDV (Especial - CDR)					
Vencimiento de Reso Especial - CDR del 15 al 19 de Junio 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 15 al 19 de Junio 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 15 al 19 de Junio del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,999.8 9,460.0	2,300.0 10,500.0	2,499.9 10,500.0	2,499.9 11,338.0	2,499.9 8,796.0
Propuestas recibidas	2,787.5 9,460.0	3,988.2 11,940.0	3,725.9 11,619.2	2,565.0 11,338.0	2,616.5 8,796.0
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d
Tasas de interés: Mínima	0.25 0.25	0.22 0.23	0.22 0.23	0.25 0.23	0.23 0.22
Máxima	0.25 0.24	0.25 0.24	0.25 0.25	0.25 0.25	0.25 0.25
Promedio	0.24 0.24	0.24 0.24	0.24 0.24	0.25 0.24	0.25 0.24
Saldo	20,960.5	22,299.7	22,299.6	23,137.6	20,596.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de Junio del 2020	11,460.5	11,000.0	11,000.0	11,838.0	10,796.5
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 15 al 19 de Junio del 2020	18,960.7	17,999.9	15,499.9	23,137.6	20,596.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,100.2	4,100.2	4,100.2	4,100.2	4,100.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 25 de Junio del 2020	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 15 al 19 de Junio 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 15 al 19 de Junio del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reestructurados del BCRP (CDR BCRP)				200.0	
Propuestas recibidas				350.0	
Plazo de vencimiento				61 d	
Tasas de interés: Mínima				0.01	
Máxima				0.05	
Promedio				0.04	
Saldo	630.0	630.0	630.0	830.0	830.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Julio del 2020	190.0	190.0	190.0	190.0	190.0
Vencimiento de CDR BCRP del 15 al 19 de Junio 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 15 al 19 de Junio del 2020					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8,745.0	8,745.0	8,745.0	8,745.0	8,745.0
Próximo vencimiento de Reso Regular el 22 de Junio del 2020	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de RSPO del 15 al 19 de Junio del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de compra					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de RSPO del 15 al 19 de Junio del 2020					
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Extensión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso Extensión					
Vencimiento de RSPO Extensión del 15 al 19 de Junio 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 Swap Sustitución					
Vencimiento de RSPO Sustitución del 15 al 19 de Junio del 2020					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP				200.0	
Propuestas recibidas				501.0	
Plazo de vencimiento				92 d	
Tasas de interés: Mínima				1.90	
Máxima				2.00	
Promedio				1.95	
Saldo	4,060.6	3,827.2	3,689.7	3,587.2	3,453.9
Próximo vencimiento de SC - Venta el 15 de Junio del 2020	233.4	137.5	137.5	133.3	600.1
Vencimiento de SC - Venta del 15 al 19 de Junio del 2020	570.9	270.8	270.8	1,033.4	900.1
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 15 al 19 de Junio del 2020					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2009-BCRP y Circular 0017-2020-BCRP)	441.0	17.8	112.1	135.7	134.2
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	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras: millones de US$	0.0	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	**5,468.8**	**3,825.5**	**3,396.8**	**3,531.1**	**5,235.4**
4. Operaciones monetarias del BCR saldo al 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 resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,640.3	2,575.6	1,506.1	1,780.2	2,300.5
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,828.5**	**1,249.9**	**1,890.7**	**1,750.9**	**2,935.9**
a. Encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	11,108.8	10,871.5	10,871.8	10,871.4	10,432.4
b. Encaje en moneda extranjera promedio acumulado (millones de US$)	4.5	4.5	4.5	4.5	4.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5,319.5	5,181.6	4,530.5	4,348.8	4,348.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TDSB) (*)	2.7	2.6	2.3	2.2	2.2
6. Mercado interbancario vmercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	5.0	50.0	230.0	795.0	385.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBOR	0.30 / 0.30 / 0.35	0.30 / 0.30 / 0.35	0.30 / 0.35 / 0.37	0.15 / 0.35 / 0.18	0.15 / 0.15 / 0.15
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)		71.0	15.0		
Tasas de interés: Mínima / Máximal Promedio		0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25		
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR vCDV	135.0				203.0
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 31 meses (monto / tasa promedio)	26 / 1.34				
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**05 Junio 20**	**08 Junio 20**	**09 Junio 20**	**10 Junio 20**	**11 Junio 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-80.3	36.7	-61.1	58.3	125.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-91.2	-21.6	-285.0	-336.7	47.8
a. Mercado spot con ex post	-133.0	-91.2	-310.2	-244.3	-58.6
b. Forwards sin ex post	52.0	69.6	224.9	580.9	173.4
i. (-) Ventas	2210.0	278.3	545.2	460.0	313.0
b. Compras forward y swap al puesto (con y sin entrega)	91.3	261.7	364.9	225.6	-123.4
i. Pactados	348.9	463.1	511.1	388.4	313.8
ii. (-) Vencidos	257.6	201.4	146.2	162.7	437.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	277.5	339.1	582.6	303.3	466.3
i. Pactados	277.5	339.1	582.6	303.3	466.3
ii. (-) Vencidos	149.9	253.9	468.4	434.9	588.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	462.2	227.2	526.2	762.3	1661.8
ii. A futuro	111.0	32.5	80.0	120.0	40.0
e. Operaciones asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-68.8	112.7	302.3	213.6	215.1
i. Compras	1164.9	1227.9	1302.8	1318.5	1351.5
ii. (-) Ventas	1233.6	1115.2	1000.5	1104.9	1136.4
f. Efecto de Opciones	-3.8	-10.7	0.1	5.2	0.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	3.1	-70.4	-62.6	-52.3	81.1
h. Liquidez por regulaciones monetarias en moneda extranjera					
Tipo de cambio					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.4287	3.4409	3.4488	3.4362	3.4546
(*) Dato preliminar					