BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	9 Nov 20		10 Nov 20		11 Nov 20		12 Nov 20		13 Nov 20	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**27,818.0**		**27,672.7**		**27,273.9**		**28,580.3**		**27,532.8**	
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones										
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR										
i. Subasta de Certificados de Depositos del BCRP (CD BCR)	200.0	300.0	300.0	500.0	299.9	200.0	500.0	1000.0	200.0	300.0
Prouestas recibidas	357.4	357.0	743.0	609.0	625.0	297.0	884.0	1354.0	526.0	397.0
Plazo de vencimiento	88 d	31 d	87 d	30 d	86 d	29 d	92 d	28 d	91 d	33 d
Tasas de interés: Mínima	0.27	0.25	0.26	0.25	0.28	0.25	0.27	0.24	0.27	0.25
Máxima	0.28	0.25	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	0.28	0.25
Saldo	38,605.4		38,815.4		39,335.3		38,935.3		39,435.3	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Noviembre del 2020	620.0		1,900.0		1,900.0		1,400.1		1,400.1	
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de Nov. del 2020	2,520.0		1,900.0		1,900.0		0.0		1,400.1	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	5,358.5		5,358.5		5,358.5		5,358.5		5,358.5	
Próximo vencimiento de Reoo de Valores el 30 de Noviembre del 2020	300.0		300.0		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de Reoo Valores del 16 al 20 de Nov. del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo							0.0		0.0	
Próximo vencimiento de Reoo de Cartera General							0.0			
Vencimiento de Reoo de Cartera General TCCOMPRA							0.0			
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	382.2		382.2		382.2		382.2		382.2	
Próximo vencimiento de Reoo 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 16 al 20 de Nov. del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		100.0	
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Reoular)										
Garantía oara los créditos										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo adudicado	53,399.9		53,399.9		53,399.9		53,399.9		53,399.9	
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)										
Garantía oara los créditos										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo adudicado	1,882.2		1,882.2		1,882.2		1,882.2		1,882.2	
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR										
Vencimiento de Reoo Especial - CDR del 16 al 20 de Nov. del 2020										
viii. Subasta de Certificados de Deósitos Variables del BCR (CDV BCRP)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDV BCRP										
Vencimientos de CDV BCRP del 16 al 20 de Nov. del 2020										
ix. Subasta de Certificados de Deósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDLD BCRP										
Vencimiento de CDLD BCRP del 16 al 20 de Nov. del 2020										
x. Subasta de Deósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 500.0	16 910.2	3 500.1	16 561.0	3 740.4	16 466.1	3 500.2	16 478.6	4 000.0	15 309.0
Prouestas recibidas	3 580.0	16 910.2	4 005.1	16 561.0	3 740.4	16 466.1	4 061.8	16 478.6	4 275.0	15 309.0
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	0.24	0.24	0.24	0.24	0.24	0.24	0.24	0.23	0.24
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	34,230.2		34,381.1		34,206.7		34,219.4		33,549.7	
Próximo vencimiento de Deósitos a Plazo el 16 de Noviembre del 2020	19,910.2		20,380.9		19,966.1		19,978.7		18,809.0	
Vencimiento de Deósitos a Plazo del 16 al 20 de Nov. del 2020	30,730.2		27,381.0		23,466.2		19,978.7		33,549.7	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	1,500.0		1,500.0		1,500.0		1,500.0		1,500.0	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Noviembre del 2020	500.0		500.0		500.0		500.0		500.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de Nov. del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		500.0	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Coloc-BN										
Vencimiento de Coloc - BN del 16 al 20 de Nov. del 2020										
xiii. Subasta de Certificados de Deósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			352.0						300.0	200.0
Prouestas recibidas			352.0						362.0	200.0
Plazo de vencimiento			91 d						91 d	91 d
Tasas de interés: Mínima			0.17						0.20	0.20
Máxima			0.25						0.23	0.25
Promedio			0.20						0.23	0.22
Saldo	7,218.0		7,570.0		7,570.0		7,570.0		7,770.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 17 de Noviembre del 2020	300.0		300.0		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 20 de Nov. del 2020	300.0		300.0		300.0		300.0		765.0	
xiv. Subasta de Certificados de Deósitos del BCR con Neoociación Restrinoida (CDBCRP-NR)										
Prouestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR										
Vencimientos de CD BCRP del 16 al 20 de Nov. del 2020										
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	5,850.0		5,850.0		5,850.0		5,930.0		5,930.0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Febrero del 2021	500.0		500.0		500.0		500.0		500.0	
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de Nov. del 2020	0.0		0.0		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 Repo										
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de Nov. 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 16 al 20 de Nov. 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 16 al 20 de Nov. del 2020										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			440.0		301.0		600.0 0	80.0 300.1	300.0 220.0	199.9 120.0
Propuestas recibidas			440.0		301.0		908.0 188.0	80.0 384.0	635.0 220.0	360.0 120.0
Plazo de vencimiento			92 d		92 d		91 d 61 d	92 d 92 d	95 d 95 d	181 d 95 d
Tasas de interés: Mínima			0.23		0.24		0.05 -	0.25 0.00	0.20 0.25	0.17 0.18
Máxima			0.25		0.25		0.25 -	0.25 0.25	0.20 0.25	0.20 0.25
Promedio			0.24		0.25		0.24 -	0.25 0.22	0.20 0.25	0.18 0.22
Saldo	7,199.0		7,639.0		7,940.0		8,920.1		9,523.4	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 17 de Noviembre del 2020	236.6		236.6		236.6		236.6		248.5	
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de Nov. del 2020	236.6		236.6		236.6		236.6		548.5	
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 16 al 20 de Nov. del 2020										
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 002	3.7		0.0		0.0		5.0		0.0	
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neopociación 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			
Tipo de cambio promedio	0.0000		0.0000		0.0000					
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			
ii. Ventas (millones de US$)										
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP										
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP										
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6,914.5**		**6,459.6**		**6,568.7**		**7,101.5**		**7,223.8**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%		0.0014%		0.0014%		0.0014%		0.0014%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,653.2		1,893.9		4,393.5		4,752.6		5,207.0	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,261.3**		**4,565.7**		**2,175.2**		**2,348.9**		**2,016.8**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,980.8		10,668.4		10,791.6		10,387.7		10,262.9	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.4		5.3		5.3		5.1		5.0	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,847.4		4,532.5		4,654.1		4,248.3		4,115.5	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.4		2.2		2.3		2.1		2.0	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	10.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	244.0		113.0		137.0		137.0		137.5	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.30 / 0.26		0.25 / 0.30 / 0.26		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	0.0		0.0		195.0		230.0			
Plazo 6 meses (monto / tasa oromedio)										
Plazo 12 meses (monto / tasa oromedio)										
Plazo 24 meses (monto / tasa oromedio)										
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**06 Noviembre 20**		**09 Noviembre 20**		**10 Noviembre 20**		**11 Noviembre 20**		**12 Noviembre 20**	
Pluio de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	78.4		1.2		82.8		-1.8		9.2	
Pluio de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	62.0		-51.0		136.1		-45.3		-45.3	
a. Mercado spot con el público	13.1		-41.8		32.6		-72.4		-95.5	
i. Compras	272.0		298.2		321.7		242.9		283.8	
ii. (-) Ventas	258.9		340.0		289.1		315.3		379.3	
b. Comoras forward v swao al oúblico (con v sin entrega)	218.3		239.2		-212.8		38.4		-194.0	
i. Pactadas	400.6		378.5		57.6		77.4		386.9	
ii. (-) Vencidas	182.2		139.3		270.4		39.1		580.9	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	201.7		187.4		-49.4		78.6		20.0	
i. Pactadas	414.4		392.9		228.2		81.8		514.6	
ii. (-) Vencidas	212.7		205.5		277.6		3.2		494.6	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	448.6		303.0		438.2		170.8		258.5	
ii. A futuro	55.0		53.0		20.0		20.0		122.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	79.6		59.4		14.2		-10.9		-37.2	
i. Comoras	207.8		183.3		264.3		2.0		493.1	
ii. (-) Ventas	128.1		123.9		250.2		12.9		530.3	
f. Efecto de Opciones	-0.3		0.4		-1.3		0.7		-1.0	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.3		-2.4		218.0		85.2		270.7	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5992		3.5857		3.6260		3.6236		3.6365	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera