

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU					
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS					
(Millones de Soles)					
	2 Mar 20	3 Mar 20	4 Mar 20	5 Mar 20	6 Mar 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	-496.4	1 443.7	2 083.6	3 077.6	2 964.7
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 BCRP)					
Propuestas recibidas	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Plazo de vencimiento	98.0	230.0	142.5	104.0	100.0
Tasas de interés	185.4	36.4	729.4	105.4	105.4
Mínima	2.09	2.10	2.18	2.30	2.30
Máxima	2.15	2.14	2.25	2.31	2.31
Promedio	2.13	2.12	2.22	2.30	2.30
Saldo	30 967.7	29 068.8	28 328.8	29 274.8	29 274.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de abril de 2020		100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 13 de marzo del 2020		100.0	100.0	100.0	100.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	1500.0	300.0	300.0	800.0	1600.0
Plazo de vencimiento	4660.0	650.0	1000.0	1000.0	1600.0
Tasas de interés	1 d	1 d	1 d	1 d	1 d
Mínima	2.35	2.35	2.28	2.25	2.25
Máxima	2.64	2.41	2.85	2.35	2.31
Promedio	2.40	2.38	2.85	2.33	2.31
Saldo	9 150.0	2 700.0	7 550.0	7 350.0	6 550.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 9 de marzo de 2020		2 700.0	1 800.0	1 800.0	1 100.0
Vencimiento de Repo de Valores del 6 al 13 de marzo del 2020		3 000.0	2 100.0	2 100.0	2 100.0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CCDD BCRP el	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CCDD BCRP del 6 al 13 de marzo del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iii. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo					
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 13 de marzo del 2020					
iv. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas	200.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Plazo de vencimiento	619.1	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés	365.4	0.0	0.0	0.0	0.0
Mínima	3.10				
Máxima	3.48				
Promedio	3.19				
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
Vencimiento de Coloc. TP del 6 al 13 de marzo del 2020		0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Certificados de Depósitos Realizables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP					
Vencimiento de CDR BCRP del 6 al 13 de marzo del 2020					
vi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resuan)					
Propuestas recibidas	300.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Plazo de vencimiento	1103.0	583.0	853.0	853.0	853.0
Tasas de interés	184.4	365.4	365.4	365.4	365.4
Mínima	2.46	2.80	2.55	2.55	2.55
Máxima	2.85	2.80	2.60	2.60	2.60
Promedio	2.78	2.80	2.58	2.58	2.58
Saldo	9 650.1	9 650.1	9 553.1	9 250.0	9 250.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 20 de marzo de 2020		500.0	300.1	300.1	400.0
Vencimiento de REPO del 6 al 13 de marzo del 2020		800.1	300.1	300.1	0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 6 al 13 de marzo del 2020					
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 6 al 13 de marzo del 2020					
ix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas			300.0	300.0	Desierta
Plazo de vencimiento			61 d	61 d	61 d
Tasas de interés			-1.10	-1.50	0.55
Mínima			-0.90	-0.70	0.80
Máxima			-1.00	-1.00	0.72
Promedio			-1.00	-1.07	0.72
Saldo	1 125.6	1 125.6	1 125.6	1 125.6	2 325.7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de marzo de 2020		300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 13 de marzo del 2020		0.0	0.0	0.0	0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 6 al 13 de marzo del 2020					
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio					
i. Ventas (millones de US\$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	8.9	0.0
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0	8.9	0.0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP / CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	4 974.8	5 113.7	4 853.6	4 647.6	4 084.7
4. Operaciones monetarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0073%	0.0073%	0.0074%	0.0073%	0.0073%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%	2.80%
c. Crédito por revaluación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	0.0	5.8	0.0	0.0	30.0
d. Depósitos Overnigth en moneda nacional					
Tasa de interés	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	4 974.8	5 107.9	4 853.6	4 647.6	4 034.7
f Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9 322.0	9 322.0	9 722.5	9 816.0	9 917.8
g Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.2	5.8	5.9	5.9	6.0
h Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 843.3	3 556.7	3 973.1	4 001.1	4 158.9
i Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.7	2.1	2.4	2.4	2.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	511.0	1 156.5	1 156.6	1 193.1	1 193.1
Tasas de interés: Mínimo / Máximo / Promedio	2,252/2,25/2,25	2,252/2,25/2,25	2,252/2,25/2,25	2,252/2,25/2,25	2,252/2,25/2,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)					
Tasas de interés: Mínimo / Máximo / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			1,251/2,25/2,25	1,251/2,25/2,25	1,251/2,25/2,25
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)			30.0		
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)			302.16		
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	28 Febrero	03 Marzo	03 Marzo	04 Marzo	05 Marzo
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	58.4	-29.2	-37.4	-40.4	-40.4
Flujo de la posición comercial = a + b - c + e + f + g	32.2	-49.0	-80.0	-85.0	-85.0
a. Mercado spot con el público	20.6	-42.5	-70.9	-68.6	-66.9
i. Compras	371.7	365.5	386.3	386.3	466.9
ii. Ventas	350.6	438.0	406.9	434.9	399.0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	52.2	154.3	210.9	173.9	5.1
i. Pacjetas	210.4	275.6	378.1	345.0	175.2
ii. Ventas	158.2	117.9	167.2	171.1	170.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	118.6	74.3	162.3	174.4	294.8
i. Pacjetas	401.3	477.6	403.7	403.7	296.9
ii. Ventas	332.6	403.3	331.3	296.1	434.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	557.9	694.3	1 067.9	1 067.9	817.0
ii. A corto plazo	86.4	96.4	96.4	96.4	146.9
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	186.0	277.4	161.6	72.5	267.7
f. Compras	317.3	307.3	237.7	237.7	433.1
g. Ventas	131.3	159.9	165.5	165.5	165.4
h. Efectos de Opciones	8.8	8.8	-11.0	8.8	8.8
i. Operaciones netas con otras instituciones financieras	86.9	-11.9	-6.7	0.7	170.2
h. Crédito por revaluación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Dabnet)	3.4539	3.4418	3.4262	3.4243	3.4437
(*) Datos preliminares					