BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	23 Mar 20	24 Mar 20	25 Mar 20	26 Mar 20	27 Mar 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3,451.0**	**3,653.5**	**3,543.6**	**3,094.7**	**2,460.9**
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)	10.0	5.0	0.0	0.0	
Propuestas recibidas	13.0	5.0	0.0	0.0	
Plazo de vencimiento	164 d	343 d	708 d	1 071 d	
Tasas de interMínima	1.22	1.25	-	-	
Máxima	1.22	1.25	-	-	
Promedio	1.22	1.25	-	-	
Saldo	29,568.7	29,573.7	29,573.7	29,573.7	29,573.7
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	1,800.0	1,800.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	200.0 200.0	200.0 0.0	200.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas	600.0 203.0	620.0 0.0	620.0	930.0	910.0
Plazo de vencimiento	365 d 1 d	365 d 1 d	184 d	186 d	185 d
Tasas de interMínima	2.41 1.26	2.40 -	2.63	2.69	2.87
Máxima	2.61 1.30	2.52 -	2.63	2.76	2.93
Promedio	2.50 1.26	2.44 -	2.63	2.71	2.92
Saldo	6,350.0	6,350.0	6,550.0	6,350.0	5,650.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 24 de abril de 2020	200.0	500.0	500.0	1,000.0	200.0
Vencimiento de Repo Valores del 30 de marzo al 3 de abril del 2020	1,700.0	1,500.0	1,500.0	1,000.0	0.0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	200.0	200.0	400.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas	510.0	415.0	795.0	1090.0	680.0
Plazo de vencimiento	730 d	1095 d	365 d	365 d	367 d
Tasas de interMínima	2.95	2.90	2.76	2.81	3.01
Máxima	3.26	3.16	3.05	3.05	3.16
Promedio	3.09	2.94	2.95	2.90	3.12
Saldo	11,050.0	11,250.0	11,050.0	11,050.0	11,150.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 1 de abril de 2020	600.0	600.0	300.0	200.0	800.0
Vencimiento de REPO del 30 de marzo al 3 de abril del 2020	1,100.0	1,100.0	500.0	1,700.0	1,500.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	0.0				
Propuestas recibidas	0.0				
Plazo de vencimiento	60 d				
Tasas de interMínima	0.00				
Máxima	0.00				
Promedio	0.00				
Saldo	6,995.8	6,995.8	6,995.8	6,995.8	6,995.8
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	300.0	300.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interMínima					
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 30 de marzo al 3 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. 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					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0.00	14.00	0.00	-19.10	0.00
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público	0.0	14.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0	19.1	0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,041.0**	**4,048.5**	**4,143.6**	**3,694.7**	**3,060.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0043%	0.0043%	0.0043%	0.0044%	0.0054%
b. Compra temporal directa de valores (fuiera de subasta)					
Tasa de interés	1.80 %	1.80 %	1.80 %	1.80 %	1.80 %
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,462.9	2,902.8	3,038.6	3,005.1	2,231.6
Tasa de interés	0.25 %	0.25 %	0.25 %	0.25 %	0.25 %
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,578.1**	**1,145.7**	**1,105.0**	**689.6**	**829.3**
a.Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,333.9	9,222.0	9,112.8	9,027.8	9,027.8
b.Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.6	5.5	5.4	5.4	5.4
c.Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,535.4	3,418.1	3,309.9	3,223.5	3,223.5
d.Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.1	2.0	2.0	1.9	1.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,529.0	1,128.0	1,452.5	1,476.5	1,621.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25	1,25/1,25/1,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	21.0	16.0			
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,25/0,25/0,25	0,25/0,25/0,25			
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**20 Marzo 20**	**23 Marzo 20**	**24 Marzo 20**	**25 Marzo 20**	**26 Marzo 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-9.1	53.0	-107.1	86.6	-33.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-93.0	86.1	-66.4	-98.8	63.5
a. Mercado spot con el público	-101.7	65.5	-92.3	-103.7	20.8
i. Compras	209.0	235.5	234.6	191.1	331.5
ii. (-) Ventas	310.7	170.0	326.9	294.7	310.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-13.0	-46.3	-63.2	-118.9	-58.4
i. Pactadas	209.2	160.6	166.7	115.3	230.4
ii. (-) Vencidas	222.2	206.9	229.9	234.3	288.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-86.0	-13.3	-23.2	-304.9	37.8
i. Pactadas	462.9	300.5	248.1	196.8	729.4
ii. (-) Vencidas	548.9	313.8	271.3	501.7	691.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	461.4	209.0	314.0	473.0	679.7
ii. A futuro	54.0	63.0	110.0	30.0	74.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	342.1	133.4	77.8	275.7	449.0
i. Compras	546.4	312.4	268.6	500.1	690.3
ii. (-) Ventas	204.3	179.1	190.8	224.4	241.3
f. Efecto de Opciones	10.8	-0.2	-0.8	-0.6	-0.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-6.6	5.8	-10.3	3.3	3.3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5173	3.5396	3.5217	3.4923	3.4233

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera