

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Abr 20	14 Abr 20	15 Abr 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4,552.8	5,109.7	5,375.8
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			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	27,513.7	27,513.7	27,513.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 5 de mayo de 2020	1,675.0	1,675.0	1,675.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
II. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas	330.0	510.0	720.0
Plazo de vencimiento	183 d	365 d	365 d
Tasas de interMinima	0.40	.61	0.61
Máxima	0.51	.76	0.86
Promedio	0.46	.68	0.72
Saldo	8,140.0	8,340.0	8,880.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 24 de abril de 2020	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de Repo Valores del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
IV. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	1,223.0	2,850.1	3,336.0
Propuestas recibidas	1,375.5	3,104.0	3,336.0
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d
Tasas de interMinima	0.16	.16	0.17
Máxima	0.25	.25	0.25
Promedio	0.22	.24	0.24
Saldo	1,223.0	2,850.1	3,336.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de abril de 2020	1,223.0	2,850.1	3,336.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 17 de abril del 2020	1,223.0	2,850.1	3,336.0
V. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	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
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
VI. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
VII. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	10,250.0	10,250.0	10,250.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de abril de 2020	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REPO del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
VIII. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
IX. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Sustitución)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
X. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	7,370.3	7,670.3	7,970.4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 27 de abril de 2020	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
XI. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interMinima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 16 al 17 de abril del 2020	0.0	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0
I. Compras (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
Tipo de cambio promedio			
II. Ventas (millones de US\$)			
Tipo de cambio promedio			
III. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)	0.00	0.0	31.7
I. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	31.7
II. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0	0.0
IV. 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	3,509.8	2,459.6	2,579.8
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)			
Comisión (tasa efectiva diaria)			
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0015%	0.0015%	0.0015%
Tasa de interés			
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	0.50%	0.50%	0.50%
Tasa de interés			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1.745.5	1.174.7	1.429.2
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	1,764.3	1,284.9	1,150.6
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)*	9,361.5	8,484.9	8,308.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.5	5.0	4.9
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,219.2	3,335.8	3,167.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.5	2.0	1.9
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	516.0	738.0	373.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.15/0.25/0.20	0.25/0.25/0.25	0.25/0.25/0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)			
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.05/0.25/0.25		
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\$)	7 Abril 20	13 Abril 20	14 Abril 20
a. Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	-89.8	7.19	-89.8
b. Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	5.1	141.9	69.1
c. Mercado spot con el público	-20.6	124.0	41.2
I. Compras	317.7	319.4	287.0
II. (-) Ventas	368.2	195.3	239.8
III. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-111.3	32.7	-44.1
I. Pactadas	152.8	216.6	112.1
II. (-) Vendidas	264.0	183.9	156.2
IV. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-67.0	102.6	189.8
I. Pactadas	337.6	414.8	490.7
II. (-) Vendidas	404.6	312.3	296.6
V. Operaciones cambiarias interbancarias			
I. Al contado	289.2	287.1	272.8
II. A futuro	89.0	69.0	235.0
VI. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	215.5	143.2	152.2
I. Compras	368.1	307.9	296.5
II. (-) Ventas	152.4	164.7	144.3
VII. Efecto de Opciones	5.8	-0.2	-0.3
VIII. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-65.8	3.0	88.7
IX. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datalec)	3.3525	3.3791	3.3925
(*) Datos preliminares			

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU		
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS		
(Millones de Soles)		
	16 Apr 20	17 Apr 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	6,796.2	7,025.0
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		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	27,513.7	27,513.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 5 de mayo de 2020	1,675.0	1,675.0
Vencimiento de CD BCRP del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)		
Propuestas recibidas	200.0	300.0
Plazo de vencimiento	240.0	900.0
Tasas de InterMinima	732.4	731.4
Máxima	1.25	1.27
Promedio	1.67	1.68
Saldo	9,080.0	9,380.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 24 de abril de 2020	200.0	200.0
Vencimiento de Repo Valores del 20 al 24 de abril del 2020	200.0	200.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)		
Propuestas recibidas	100.0	100.0
Plazo de vencimiento	109.4	30.4
Tasas de InterMinima	0.27	0.24
Máxima	0.75	0.33
Promedio	0.33	0.0
Saldo	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 20 de mayo de 2020	100.0	100.0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo		
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR		
Vencimiento de REPO Especial - CDR del 20 al 24 de abril del 2020		
v. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidados en Dólares del BCR (CDLD BCRP)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP	0.0	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
vi. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional		
Propuestas recibidas	3,749.8	5,120.3
Plazo de vencimiento	3,749.8	5,120.3
Tasas de InterMinima	1.4	3.4
Máxima	0.18	0.18
Promedio	0.25	0.25
Saldo	3,749.8	5,120.3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de abril de 2020	3,749.8	5,120.3
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 20 al 24 de abril del 2020	3,749.8	5,120.3
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	4,100.2	4,100.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 25 de junio de 2020	300.0	300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
ix. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Regular)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	10,290.0	10,290.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 24 de abril de 2020	200.0	200.0
Vencimiento de REPO del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	200.0
x. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Expansión)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
xi. Compra con compromiso de Reconpra de moneda extranjera (Sustitución)		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0.0	0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
xii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	7,970.4	7,970.4
Próximo vencimiento de SC-Venta el 27 de abril de 2020	300.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
xiii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP		
Propuestas recibidas		
Plazo de vencimiento		
Tasas de InterMinima		
Máxima		
Promedio		
Saldo	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 20 al 24 de abril del 2020	0.0	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR		
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\$)		
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0.0	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	0.0	0.0
ii. Compras de BTP	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3,246.4	2,204.7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones		
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)		
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%	0.0015%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)		
Tasa de interés	0.50 %	0.50 %
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional		
Tasa de interés	2,454.8	1,666.7
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.15 %	0.15 %
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	791.6	638.0
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,174.3	8,024.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.8	4.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,032.7	2,879.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.8	1.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP		
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	691.5	678.0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / TIBO	0,20/0,25/0,24	0,20/0,25/0,21
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)		
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio		20.0
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV		0,25/0,25/0,25
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\$)	15 Abril 20	16 Abril 20
Flujo de la posición global = a + b i - c i + e + f + g	52.7	-10.7
Flujo de la posición contable = a + b ii - c ii + e + g	-67.9	13.5
a. Mercado spot con el público	-107.0	13.2
i. Compras	256.9	361.5
ii. (-) Ventas	363.8	348.3
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	88.8	-218.0
i. Paquetadas	250.8	154.6
ii. (-) Vendidas	163.9	370.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	46.3	-192.7
i. Paquetadas	471.1	1038.0
ii. (-) Vendidas	424.8	1238.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias		
i. Al contado	513.4	349.2
ii. A futuro	74.0	22.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	308.3	867.4
i. Compras	425.6	1197.0
ii. (-) Ventas	117.3	329.6
f. Efecto de Opciones	-13.7	-1.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	88.3	-8.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera		
Tasa de interés		
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.4198	3.4084
(*) Básicos preliminares		