BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Abr 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5,857.4**
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 BCR)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	27,513.7
Próximo vencimiento de CD BCRPel 5 de Mayo del 2020	1,675.0
Vencimiento de CD BCRP del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
ii.Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	600.0
Propuestas recibidas	600.0
Plazo de vencimiento	365 d
Tasas de interés: Mínima	0.59
Máxima	1.0
Promedio	0.80
Saldo	11,315.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de Mayo del 2020	200.0
Vencimiento de Repo Valores del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
iii.Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (REPO CART Alternativo)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	250.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 20 de mayo de 2020	100.0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
iv.Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (REPO GART Regular)	
Garantía para los créditos	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	7,995.6
v.Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	
Próximo vencimiento de CDV BCRP	
Vencimientos de CDV BCRP del 28 al 30 de Abril del 2020	
vi.Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
vii.Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3302.9
Propuestas recibidas	3302.9
Plazo de vencimiento	1 d
Tasas de interés: Mínima	0.20
Máxima	0.25
Promedio	0.24
Saldo	3,302.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de Abril del 2020	3,302.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 al 30 de Abril del 2020	3,302.9
ix.Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	
Próximo vencimiento de Coloc-BN	
Vencimiento de Coloc - BN del 28 al 30 de Abril del 2020	
x.Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	
Próximo vencimiento de CDBCRP.NR	
Vencimientos de CD BCRP del 28 al 30 de Abril del 2020	
xii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	
Próximo vencimiento de Repo	
Vencimiento de REPO del 28 al 30 de Abril del 2020	
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion	0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
xvi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion	0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
xvii. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimiento	
Tasas de interés: Mínima	
Máxima	
Promedio	
Saldo	7,520.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de abril de 2020	210.6
Vencimiento de SC - Venta del 28 al 30 de Abril del 2020	210.6
xviii. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP	
Propuestas recibidas	
Plazo de vencimi Mínima	
Tasas de interés: Máxima	
Promedio	
Saldo	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0
Vencimiento de SC - Compra del 28 al 30 de Abril del 2020	0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	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$)	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público	0.0
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público	0.0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	
ii. Compras de BTP	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,154.5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones	
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).	
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	
Tasa de interés	0.50 %
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional	
Tasa de interés	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,779.2
Tasa de interés	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,375.3**
a.Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	7,203.4
b.Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2
c.Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,052.2
d.Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP	
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,042.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25/0.25/0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	
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$)	**24 Abril 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-52.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	114.2
a. Mercado spot con el público	129.0
i. Compras	374.0
ii. (-) Ventas	245.0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	76.8
i. Pactadas	246.9
ii. (-) Vencidas	170.0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	243.1
i. Pactadas	516.1
ii. (-) Vencidas	273.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias	
i. Al contado	377.0
ii. A futuro	278.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	102.4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera	
Tasa de interés	
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.3806

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	28 Abr 20				29 Abr 20				30 Abr 20			
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**6,138.2**				**7,442.8**				**7,699.7**			
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 BCR)												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	27,513.7				27,513.7				27,513.7			
Próximo vencimiento de CD BCRPel 5 de Mayo del 2020	1,675.0				1,675.0				1,675.0			
Vencimiento de CD BCRP del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				3,140.0				3,140.0			
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	1000.0				400.0				300.0			
Propuestas recibidas	1300.0				500.0				400.0			
Plazo de vencimiento	730 d				183 d				91 d			
Tasas de interés: Mínima	1,28				0,51				0,51			
Máxima	1,72				0,65				0,63			
Promedio	1,57				0,58				0,59			
Saldo	12,315.0				12,715.0				13,015.0			
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de Mayo del 2020	200.0				200.0				200.0			
Vencimiento de Repo Valores del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
iiiSubasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (REPO CART Alternativo)												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	250.0				250.0				250.0			
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 20 de Mayo de 2020	100.0				100.0				100.0			
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
ivSubasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (REPO GART Regular)	1500.0	1800.0	600.0	35.5	1000.0	1000.0	400.0	9.0	1000.0	1000.0	400.0	21.5
Garantía para los créditos	80%	90%	95%	98%	80%	90%	95%	98%	80%	90%	95%	98%
Propuestas recibidas	3797.6	3959.4	1053.7	45.4	2142.4	2123.9	682.6	18.3	2002.1	2013.1	704.7	32.0
Plazo de vencimiento	1097 d	1097 d	1097 d	1097 d	1096 d	1096 d	1096 d	1096 d	1095 d	1095 d	1095 d	1095 d
Tasas de interés: Mínima	0,98	0,95	0,80	1,11	1,02	1,05	0,95	2,85	1,08	1,09	1,0	2,95
Máxima	1,12	1,12	1,16	2,99	1,17	1,18	1,23	2,99	1,18	1,15	1,20	3,01
Promedio	1,03	1,05	1,06	2,21	1,08	1,12	1,12	2,92	1,13	1,12	1,16	2,98
Saldo	11,931.1				14,340.1				16,761.6			
v.Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (REPO GART Especial)	27,0				15,0				15,0			
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo												
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR												
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 4 al 8 de Mayo del 2020												
viSubasta 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 4 al 8 de Mayo del 2020												
viSubasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	0.0				0.0				0.0			
Próximo vencimiento de CDLD BCRP	0.0				0.0				0.0			
Vencimiento de CDLD BCRP del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
ixSubasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3451.6				4912.9				4499.8			
Propuestas recibidas	3451,6				4932.9				4950,0			
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	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			
Vencimiento de Coloc-TP del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
xSubasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
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 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
xiSubasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	10,230.0				10,230.0				10,030.0			
Próximo vencimiento de Repo Regular el 4 de Mayo del 2020	200.0				200.0				200.0			
Vencimiento de REPO del 4 al 8 de Mayo del 2020	200.0				600.0				400.0			
xiiVenta 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 4 al 8 de Mayo del 2020												
xiCompra 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			
Próximo vencimiento de Repo Expansion	0.0				0.0				0.0			
Vencimiento de REPO Expansión del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
xiiCompra 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			
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion	0.0				0.0				0.0			
Vencimiento de REPO Sustitución del 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
xiiSubasta de Swap Cambiario Venta del BCRP												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimiento												
Tasas de interés: Mínima												
Máxima												
Promedio												
Saldo	7,520.9				7,520.9				7,310.3			
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de Mayo del 2020	210.6				210.6				600.0			
Vencimiento de SC - Venta del 4 al 8 de Mayo del 2020	210.6				1,110.6				900.0			
xiv. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP												
Propuestas recibidas												
Plazo de vencimi Mínima												
Tasas de interés: 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 4 al 8 de Mayo del 2020	0.0				0.0				0.0			
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0				70.7				0.0			
i. Compras (millones de US$)					21.0				0.0			
Tipo de cambio promedio					3.3671							
ii. Ventas (millones de US$)												
Tipo de cambio promedio												
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0.0				0.0				0.0			
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público	0.0				0.0				0.0			
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público	0.0				0.0				0.0			
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP												
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR												
ii. Compras de BTP												
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,686.6**				**3,000.6**				**3,499.7**			
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones												
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).												
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0015%				0.0015%				0.0015%			
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)												
Tasa de interés	0.50 %				0.50 %				0.50 %			
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional												
Tasa de interés												
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,655.9				2,426.0				1,365.0			
Tasa de interés	0,15%				0,15%				0,15%			
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,030.7**				**674.6**				**2,134.7**			
a.Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	7,212.7				7,165.4				7,103.1			
b.Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2				4.2				4.2			
c.Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,060.0				2,012.6				1,949.5			
d.Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.2				1.2				1.1			
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP												
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	584.0				265.0				343.0			
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0,25/0,25/0,25				0,20/0,25/0,25				0,25/0,25/0,25			
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)												
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio												
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV					270.0							
Plazo 8 meses (monto / tasa promedio)					150.0/0.89							
Plazo 9 meses (monto / tasa promedio)					50.0/0.95							
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					20.0/0.42							
Plazo 15 meses (monto / tasa promedio)	**27 Abril 20**				**50.0/1.28**							
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	55.2				28 Abril 20				29 Abril 20			
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	100.6				-6.3				42.5			
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	78.4				59.5				-93.8			
a. Mercado spot con el público.	313.5				60.6				-115.1			
i. Compras	235.2				337.9				278.9			
ii. (-) Ventas	554.2				277.3				394.0			
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	234.6				-250.7				-428.0			
ii. (-) Vencidas					719.7				1105.3			
d. Operaciones cambiarias interbancarias	307.4											
i. Al contado	92.0				306.3				430.9			
ii. A futuro	135.5				43.0				38.0			
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	233.7				349.8				460.2			
i. Compras	98.2				685.0				1105.0			
ii. (-) Ventas	-0.5				335.2				654.8			
f. Efecto de Opciones	-54.4				-5.1				30.0			
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					-20.1				-51.9			
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera												
Tasa de interés	3.3998											
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)					3.4				3.4			

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera