BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	22 Jun 20		23 Jun 20		24 Jun 20		25 Jun 20		26 Jun 20	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**15,656.3**		**14,850.1**		**17,392.9**		**16,937.6**		**17,978.8**	
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 BCR)	68.0	200.0	100.0	207.0	100.0	150.0	59.0	200.0	55.0	200.0
Propuestas recibidas	146.0	212.0	199.0	207.0	162.0	250.0	112.0	209.0	55.0	365.0
Plazo de vencimiento	346 d	29 d	345 d	28 d	344 d	27 d	343 d	29 d	342 d	28 d
Tasas de interés: Mínima	0.44	0.24	0.44	0.25	0.44	0.25	0.44	0.25	0.45	0.25
Máxima	0.45	0.25	0.45	0.25	0.45	0.25	0.45	0.25	0.45	0.25
Promedio	0.44	0.25	0.45	0.25	0.45	0.25	0.44	0.25	0.45	0.25
Saldo	30,605.7		30,962.7		31,212.7		31,471.7		30,988.7	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 26 de Junio del 2020	738.0		738.0		738.0		738.0		160.0	
Vencimiento de CD BCRP del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	738.0		738.0		738.0		2,619.0		1,881.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	15,517.0		15,447.0		15,447.0		15,447.0		15,247.0	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 26 de Junio del 2020	150.0		200.0		200.0		200.0		300.0	
Vencimiento de Repo Valores del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	350.0		200.0		200.0		500.0		300.0	
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	10.0		10.0		10.0		10.0		10.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General el 14 de Agosto del 2020	10.0		10.0		10.0		10.0		10.0	
Vencimiento de Repo de Cartera General del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	250.0		250.0		250.0		250.0		250.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 23 de Julio del 2020	150.0		150.0		150.0		150.0		150.0	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)										
Garantía para los créditos										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo adjudicado	29,795.9		29,795.9		29,795.9		29,795.9		29,795.9	
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)										
Garantía para los créditos										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo adjudicado	204.1		204.1		204.1		204.1		204.1	
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO Especial - CDR)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR										
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
viii. Subasta 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 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDLD BCRP										
Vencimiento de CDLD BCRP del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 437.5	8 357.4	1 518.5	8 143.0	2 116.0	10 009.0	2 055.3	9 145.3	2 500.1	10 210.7
Propuestas recibidas	2 437.5	8 357.4	1 518.5	8 143.0	2 116.0	10 009.0	2 055.3	9 145.3	2 519.0	10 210.7
Plazo de vencimiento	8 d	14 d	7 d	14 d	7 d	14 d	7 d	14 d	7 d	14 d
Tasas de interés: Mínima	0.23	0.23	0.24	0.23	0.24	0.23	0.24	0.24	0.24	0.21
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	0.24
Saldo	20,294.8		19,598.9		21,081.1		19,772.7		20,838.1	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Junio del 2020	10,357.4		10,642.8		12,509.0		11,645.4		14,166.7	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	17,857.3		15,642.9		15,009.1		19,772.7		20,838.1	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	4,100.2		4,100.2		4,100.2		3,800.2		3,800.2	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 30 de Junio del 2020	300.0		300.0		300.0		800.1		800.1	
Vencimiento de Coloc-TP del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	300.0		300.0		300.0		800.1		800.1	
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Coloc-BN										
Vencimiento de Coloc - BN del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			200.0		200.0					
Propuestas recibidas			450.0		200.0					
Plazo de vencimiento			59 d		61 d					
Tasas de interés: Mínima					0.00					
Máxima					0.00					
Promedio					0.00					
Saldo	1,780.0		1,980.0		2,180.0		2,180.0		2,180.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Julio del 2020	190.0		190.0		190.0		190.0		190.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR										
Vencimientos de CD BCRP del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
xv. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	8,545.0		8,545.0		8,395.0		8,395.0		8,395.0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 30 de Junio del 2020	150.0		150.0		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de REPO del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	150.0		150.0		0.0		900.0		900.0	
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 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
xvii. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Expansión)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo Expansion										
Vencimiento de REPO Expansión del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
xviii. Comora con comoromiso de Recomora de moneda extraniera (Sustitución)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion										
Vencimiento de REPO Sustitución del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			200.0		200.0					
Propuestas recibidas			434.0		592.0					
Plazo de vencimiento			59 d		61 d					
Tasas de interés: Mínima			-0.70		-0.60					
Máxima			-0.30		-0.20					
Promedio			-0.46		-0.38					
Saldo	3,003.9		3,203.9		3,403.9		3,403.9		3,403.9	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Julio del 2020	194.2		194.2		194.2		194.2		194.2	
Vencimiento de SC - Venta del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020	0.0		0.0		0.0		194.2		194.2	
xx. Subasta de Swap Cambiario Comora del BCRP										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimie Mínima										
Tasas de interés: Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de SC-Compra										
Vencimiento de SC - Comora del 26 de Junio al 3 de Julio del 2020										
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP y Circular 0017-2020-BCRP)	155.8		1,959.1		529.8		3.5		341.1	
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCRP	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										
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0		0.0		0.4		0.0		1,468.3	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.0		0.4		0.0		1,468.3	
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP										
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP										
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,749.3**		**6,720.7**		**5,347.8**		**5,481.5**		**5,354.1**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Comora temporal de moneda extranjera (basada.										
Comisión flata efectiva diaria)	0.0015%		0.0015%		0.0015%		0.0015%		0.0015%	
b. Comora temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	878.2		2,238.8		1,814.0		1,807.0		1,407.3	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,871.1**		**4,483.9**		**3,533.8**		**3,674.5**		**3,746.8**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,710.0		9,752.2		9,802.2		9,751.2		9,749.2	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% de TRAMN) (*)	5.0		5.0		5.0		5.0		5.0	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,897.5		3,938.5		3,986.5		3,930.5		3,926.1	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	2.0		2.0		2.0		2.0		2.0	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	394.0		0.0		186.0		396.0		166.0	
Tasas de interés Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25		- / - / 0.19		0.15 / 0.20 / 0.19		0.15 / 0.20 / 0.16		0.15 / 0.15 / 0.19	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	40.0				72.0					
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	1.3									
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)										
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**19 Junio 20**		**22 Junio 20**		**23 Junio 20**		**24 Junio 20**		**25 Junio 20**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-4.0		-162.3		104.2		120.8		-61.4	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + d	-12.4		54.5		175.1		81.3		-87.9	
a. Mercado spot con el público	-106.8		-95.7		36.7		-40.1		-190.3	
i. Compras	207.7		177.2		301.6		288.4		269.1	
ii. (-) Ventas	314.3		273.0		264.9		328.5		459.4	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	40.6		-70.1		167.4		-236.9		-302.8	
i. Pactadas	321.7		228.8		276.5		166.8		227.0	
ii. (-) Vencidas	281.0		298.9		109.2		403.5		530.7	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	21.7		136.6		286.5		-210.2		-319.4	
i. Pactadas	325.4		305.9		366.7		227.4		172.8	
ii. (-) Vencidas	303.7		169.3		80.2		437.6		492.1	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	261.1		393.8		361.4		381.3		479.1	
ii. A futuro	90.0		90.0		10.0		0.0		86.0	
e. Operaciones por capitales a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	138.7		74.7		60.6		115.1		75.7	
i. Compras	501.8		168.7		79.5		477.4		488.6	
ii. (-) Ventas	173.1		144.1		13.9		312.3		412.9	
f. Efecto de Opciones	-10.5		-10.1		-8.7		9.4		9.9	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-11.9		-4.1		100.7		97.1		-11.8	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5123		3.4952		3.5181		3.5257		3.5074	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera