**RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS**
**(Millones de Soles)**

| | 03 Ago 20 | 04 Ago 20 | 05 Ago 20 | 06 Ago 20 | 07 Ago 20 |
|---|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **23,583.9** | **21,964.0** | **25,452.4** | **25,359.3** | **23,120.0** |
| **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 BCR) | 60.0 499.9 | 20.0 39.0 500.0 | Desierta 30.0 500.0 | 100.0 100.0 800.0 | 95.0 800.0 |
| Propuestas recibidas | 220.0 905.0 | 145.0 244.0 873.5 | 25.0 165.0 576.7 | 125.0 196.0 1900.0 | 140.0 2258.4 |
| Plazo de vencimiento | 365 d 31 d | 364 d 189 d 30 d | 363 d 188 d 29 d | 362 d 187 d 33 d | 186 d 32 d |
| Tasas de interés: Mínima | 0.37 0.24 | 0.37 0.30 0.20 | -.- 0.30 0.24 | 0.37 0.30 0.24 | 0.29 0.23 |
| Máxima | 0.37 0.25 | 0.37 0.31 0.25 | -.- 0.30 0.25 | 0.37 0.31 0.25 | 0.30 0.24 |
| Promedio | 0.37 0.25 | 0.37 0.31 0.25 | -.- 0.30 0.25 | 0.37 0.30 0.24 | 0.30 0.24 |
| Saldo | 32,301.9 | 30,826.5 | 31,356.5 | 29,842.5 | 30,737.5 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de Agosto del 2020 | 2,086.4 | 2,514.0 | 2,514.0 | 2,050.0 | 2,050.0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 4,600.4 | 2,514.0 | 2,514.0 | 3,281.9 | 3,281.9 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 14,452.0 | 13,352.5 | 13,385.5 | 13,385.5 | 13,385.5 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 4 de Agosto del 2020 | 500.0 | 845.0 | 845.0 | 845.0 | 845.0 |
| Vencimiento de Reoo Valores del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 500.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| 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 Reoo de Cartera General del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 10.0 | 10.0 |
| iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 143.6 | 143.6 | 143.6 | 143.6 | 143.6 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 18 de Noviembre del 2020 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 |
| Vencimiento de Reoo de Cartera Alternativo del 4 al 7 de Agosto 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) | Desierta 10.5 400.0 50.0 | | Desierta Desierta 4.5 50.0 | | |
| Garantía para los créditos | 98% 95% 90% 80% | | 98% 95% 90% 80% | | |
| Propuestas recibidas | -.- 10.5 416.4 50.0 | | -.- -.- 4.5 50.0 | | |
| Plazo de vencimiento | 1094 d 1094 d 1094 d 1094 d | | 1094 d 1094 d 1094 d 1094 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | -.- 1.60 1.50 1.99 | | -.- -.- 1.38 2.0 | | |
| Máxima | -.- 1.60 2.10 1.99 | | -.- -.- 1.38 2.0 | | |
| Promedio | -.- 1.60 2.02 1.99 | | -.- -.- 1.38 2.0 | | |
| Saldo adjudicado | 50,512.1 | 50,512.1 | 50,566.6 | 50,566.6 | 50,566.6 |
| vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial) | Desierta | | Desierta | | |
| Garantía para los créditos | 98% | | 98% | | |
| Propuestas recibidas | 0.0 | | -.- | | |
| Plazo de vencimiento | 1094 d | | 1094 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | -.- | | -.- | | |
| Máxima | -.- | | -.- | | |
| Promedio | -.- | | -.- | | |
| Saldo adjudicado | 1,496.2 | 1,496.2 | 1,496.2 | 1,496.2 | 1,496.2 |
| 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 Reoo Especial - CDR del 4 al 7 de Agosto 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 4 al 7 de Agosto 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 4 al 7 de Agosto del 2020 | | | | | |
| x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 2 989.0 12 572.0 | 1 500.2 12 800.1 | 3 999.9 13 350.0 | 3 500.0 13 500.1 | 2 500.0 13 000.0 |
| Propuestas recibidas | 2 989.0 12 572.0 | 2 678.5 12 837.5 | 4 775.1 13 520.7 | 4 706.5 14 417.5 | 3 933.5 14 010.1 |
| Plazo de vencimiento | 7 d 1 d | 7 d 1 d | 7 d 1 d | 7 d 1 d | 7 d 3 d |
| Tasas de interés: Mínima | 0.23 0.22 | 0.23 0.21 | 0.23 0.22 | 0.23 0.23 | 0.24 0.22 |
| Máxima | 0.25 0.25 | 0.25 0.25 | 0.25 0.25 | 0.25 0.25 | 0.25 0.24 |
| Promedio | 0.25 0.24 | 0.24 0.24 | 0.24 0.24 | 0.24 0.24 | 0.24 0.24 |
| Saldo | 23,545.8 | 25,274.1 | 25,823.9 | 27,474.2 | 27,489.1 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 4 de Agosto del 2020 | 12,572.0 | 16,800.1 | 15,349.8 | 15,485.1 | 15,989.0 |
| Vencimiento de Deoósitos a Plazo del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 20,556.8 | 20,784.9 | 17,334.8 | 27,474.2 | 27,489.1 |
| xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 2,500.1 | 2,500.1 | 2,500.1 | 2,500.1 | 2,500.1 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 26 de Octubre del 2020 | 500.1 | 500.1 | 500.1 | 500.1 | 500.1 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| 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 4 al 7 de Agosto del 2020 | | | | | |
| xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | Desierta | | 200.0 | | |
| Propuestas recibidas | 20.0 | | 430.0 | | |
| Plazo de vencimiento | 60 d | | 61 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | -.- | | -0.05 | | |
| Máxima | -.- | | 0.14 | | |
| Promedio | -.- | | 0.03 | | |
| Saldo | 2,840.0 | 2,840.0 | 3,040.0 | 3,040.0 | 3,040.0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 11 de Agosto del 2020 | 200.0 | 200.0 | 200.0 | 200.0 | 200.0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 540.0 | 540.0 |
| xiv. Subasta de Certificados de Deoósitos del BCR con Neoociación Restrinoida (CDBCRP-NR) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de CDBCRP-NR | | | | | |
| Vencimientos de CD BCRP del 4 al 7 de Agosto del 2020 | | | | | |
| xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | 7,195.0 | 6,895.0 | 6,895.0 | 6,895.0 | 6,895.0 |
| Próximo vencimiento de Reoo Reoular el 4 de Aoosto del 2020 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 300.0 | 300.0 |
| Vencimiento de REPO del 4 al 7 de Aoosto del 2020 | 300.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Reoo | | | | | |
| Vencimiento de REPO del 4 al 7 de Aoosto del 2020 | | | | | |
| xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Reoo Exoansion | | | | | |
| Vencimiento de REPO Expansión del 4 al 7 de Agosto del 2020 | | | | | |
| xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución) | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | | |
| Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de Reoo Sustitucion | | | | | |
| Vencimiento de REPO Sustitución del 4 al 7 de Agosto del 2020 | | | | | |
| xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | | 200.0 | | 199.9 |
| Propuestas recibidas | | | 370.0 | | 495.0 |
| Plazo de vencimiento | | | 61 d | | 61 d |
| Tasas de interés: Mínima | | | -0.25 | | -0.45 |
| Máxima | | | 0.00 | | -0.25 |
| Promedio | | | -0.08 | | -0.30 |
| Saldo | 1,182.9 | 1,182.9 | 1,382.9 | 1,382.9 | 1,532.8 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Agosto del 2020 | 335.0 | 335.0 | 335.0 | 335.0 | 335.0 |
| Vencimiento de SC - Venta del 4 al 7 de Agosto del 2020 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 700.1 | 700.1 |
| xx. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP | | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | | |
| Plazo de vencimient Mínima | | | | | |
| Tasas de interés: Máxima | | | | | |
| Promedio | | | | | |
| Saldo | | | | | |
| Próximo vencimiento de SC-Compra | | | | | |
| Vencimiento de SC - Compra del 4 al 7 de Agosto del 2020 | | | | | |
| b. Liquidación de Reoos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP) | 112.4 | 1,229.1 | 171.4 | 215.4 | 651.5 |
| c. 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 | | | | | |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 4.0 | 0.0 | 816.3 | 0.0 | 306.0 |
| i. Compras (millones de US$) | 4.0 | 0.0 | 816.3 | 0.0 | 306.0 |
| 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** | **7,575.5** | **8,333.8** | **7,543.9** | **7,574.5** | **7,376.5** |
| **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% | 0.0015% | 0.0015% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | | | | | |
| Tasa de interés | 0.50% | 0.50% | 0.50% | 0.50% | 0.50% |
| c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 1,169.4 | 1,722.7 | 1,155.0 | 923.6 | 1,221.6 |
| 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** | **6,406.1** | **6,611.1** | **6,388.9** | **6,650.9** | **6,154.9** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 9,312.2 | 10,954.4 | 11,353.4 | 11,508.9 | 11,735.3 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 4.7 | 5.4 | 5.6 | 5.7 | 5.8 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 3,308.2 | 4,799.3 | 5,202.7 | 5,363.4 | 5,584.7 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1.7 | 2.4 | 2.6 | 2.6 | 2.7 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 150.0 | | 96.0 | 93.0 | 63.0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 0.15 / 0.15 / 0.25 | - / - / 0.25 | 0.15 / 0.15 / 0.25 | 0.15 / 0.25 / 0.25 | 0.15 / 0.20 / 0.24 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | | | 53.0 | 20.0 | 20.0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio | | | 0.04 / 0.05 / 0.05 | 0.05 / 0.05 / 0.05 | 0.05 / 0.05 / 0.05 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | | | | | 90.0 |
| 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$)** | **31 Julio 20** | **03 Agosto 20** | **04 Agosto 20** | **05 Agosto 20** | **06 Agosto 20** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | -15.7 | 27.1 | 44.1 | 47.2 | 14.6 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o | -51.5 | -9.4 | -58.6 | -13.0 | -127.1 |
| a. Mercado spot con el público | -129.2 | -66.2 | -76.0 | -76.7 | -117.3 |
| i. Compras | 285.8 | 225.9 | 238.9 | 216.3 | 235.9 |
| ii. (-) Ventas | 415.0 | 292.1 | 314.9 | 293.0 | 353.3 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | 133.9 | 169.3 | 52.5 | 10.1 | -142.9 |
| i. Pactadas | 320.3 | 352.4 | 196.4 | 240.3 | 290.8 |
| ii. (-) Vencidas | 186.4 | 183.1 | 143.9 | 230.2 | 433.7 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | 97.3 | 129.4 | -50.8 | -3.7 | -217.2 |
| i. Pactadas | 343.1 | 366.7 | 186.3 | 256.2 | 392.8 |
| ii. (-) Vencidas | 245.7 | 237.3 | 237.0 | 259.9 | 610.0 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | | |
| i. Al contado | 228.0 | 206.3 | 375.2 | 361.3 | 521.5 |
| ii. A futuro | 0.0 | 10.0 | 20.0 | 0.0 | 63.0 |
| e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | 136.6 | 115.0 | 97.5 | 44.2 | 249.4 |
| i. Compras | 238.7 | 228.0 | 216.5 | 259.8 | 577.9 |
| ii. (-) Ventas | 102.1 | 113.1 | 119.0 | 215.7 | 328.5 |
| f. Efecto de Opciones | -0.7 | -3.5 | -0.6 | -9.9 | 11.0 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 0.4 | -4.0 | -7.0 | 105.6 | -26.6 |
| h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 3.5303 | 3.5428 | 3.5490 | 3.5485 | 3.5469 |

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera