BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	28 Set 20	29 Set 20	30 Set 20	1 Oct 20	2 Oct 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**28,011.7**	**28,096.8**	**28,732.9**	**28,573.1**	**29,165.8**
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)	413.0	300.0 200.0	201.0		300.0 109.0
Propuestas recibidas	463.0	320.0 210.0	211.0		326.0 147.0
Plazo de vencimiento	91 d	90 d 29 d	89 d		95 d 31 d
Tasas de interés: Mínima	0.26	0.27 0.25	0.27		0.25 0.25
Máxima	0.28	0.28 0.25	0.28		0.28 0.25
Promedio	0.27	0.27 0.25	0.28		0.28 0.25
Saldo	37,937.7	38,437.7	38,638.7	38,638.7	37,858.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Octubre del 2020	1,239.0	1,239.0	1,239.0	1,239.0	2,305.1
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de Oct. del 2020	1,239.0	1,239.0	1,239.0	1,239.0	4,234.8
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8,603.5	8,603.5	8,603.5	7,603.5	7,303.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de Octubre del 2020	1,000.0	1,000.0	1,000.0	300.0	500.0
Vencimiento de Repo Valores del 5 al 9 de Oct. del 2020	1,300.0	1,300.0	1,300.0	300.0	560.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General TCCOMPRA					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	307.2	310.8	310.8	310.8	310.8
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 Repo de Cartera Alternativo del 5 al 9 de Oct. 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)				60.3 115.7 10.4 Desierta	
Garantía para los créditos				98% 95% 90% 80%	
Propuestas recibidas				60,3 115,7 10,4	
Plazo de vencimiento				1096 d 1096 d 1096 d 1096 d	
Tasas de interés: Mínima				4,25 1,80 2,20 -.-	
Máxima				4,99 2,75 2,25 -.-	
Promedio				4,46 2,26 2,20 -.-	
Saldo adjudicado	53,041.9	53,041.9	53,041.9	53,228.3	53,228.3
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)				21.1	
Garantía para los créditos				98%	
Propuestas recibidas				21.1	
Plazo de vencimiento				1096 d	
Tasas de interés: Mínima				4.00	
Máxima				5.00	
Promedio				4.95	
Saldo adjudicado	1,854.6	1,854.6	1,854.6	1,875.7	1,875.7
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 5 al 9 de Oct. 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 5 al 9 de Oct. 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 5 al 9 de Oct. del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 357.0 17 066.4	1 999.9 17 572.5	2 000.2 17 376.5	2 493.9 16 244.0	2 999.9 16 760.7
Propuestas recibidas	2 357,0 17 066,4	2 156,0 17 572,5	3 200,0 17 376,5	2 493,9 16 244,0	3 683,0 16 760,7
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	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 0,24	0,24 0,24
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 0,25
Saldo	30,709.4	31,278.5	29,233.5	27,594.9	28,611.6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 5 de Octubre del 2020	19,003.3	21,421.7	20,376.5	18,743.9	19,117.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 9 de Oct. del 2020	28,352.4	26,921.6	22,876.4	18,743.9	28,611.6
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 5 al 9 de Oct. 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 5 al 9 de Oct. del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	40,0	300,0 300,0	200,0	200,0	200,0 200,0 300,0
Propuestas recibidas	40,0	595,0 597,0	325,0	280,0	400,0 200,0 465,0
Plazo de vencimiento	91 d	62 d 91 d	91 d	95 d	94 d 94 d 95 d
Tasas de interés: Mínima	0,00	0,05 -0,10	0,15	0.00	0,00 0,13 0,00
Máxima	0,25	0,15 0,10	0,22	0,20	0,14 0,25 0,17
Promedio	0,09	0,10 0,04	0,18	0,12	0,06 0,19 0,12
Saldo	4,440.0	5,040.0	5,040.0	5,240.0	5,940.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 5 de Octubre del 2020	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 9 de Oct. del 2020	200.0	200.0	0.0	0.0	200.0
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 5 al 9 de Oct. del 2020					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6,107.7	6,107.7	5,907.7	5,907.7	5,707.7
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Febrero del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	500.0
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de Oct. del 2020	400.0	400.0	200.0	200.0	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 Repo					
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de Oct. 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 Repo Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 5 al 9 de Oct. 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 Repo Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 5 al 9 de Oct. del 2020					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					9,0 300,0
Propuestas recibidas					36,0 360,0
Plazo de vencimiento					95 d 95 d
Tasas de interés: Mínima					0,25 0,15
Máxima					0,25 0,25
Promedio					0,25 0,18
Saldo	4,976.7	4,976.7	4,926.7	4,926.7	5,235.7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 5 de Octubre del 2020	50.0	50.0	150.0	150.0	150.0
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 9 de Oct. del 2020	50.0	50.0	0.0	0.0	349.9
xx. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento Mínima					
Tasas de interés: Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 5 al 9 de Oct. del 2020					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-202	743.0	1.6	1.6	9.3	120.7
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	-3.6	0.0	43.4
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)			1.0	0.0	12.0
Tipo de cambio promedio			3.6060	0.0	3.6200
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	13.6	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	13.6	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8,878.3**	**7,426.0**	**8,956.3**	**9,644.5**	**8,410.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	7,870.8	6,360.8	7,765.4	4,188.5	4,279.3
Tasa de interés	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,007.5**	**1,065.2**	**1,190.9**	**5,456.0**	**4,131.0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,473.7	8,420.1	8,380.6	8,349.5	11,571.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2	4.1	4.1	5.7	5.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,365.8	2,311.1	2,271.5	2,240.7	5,456.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.2	1.1	1.1	1.1	2.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	150.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0,25/ 0,25 / 0,25	0,25/ 0,25 / 0,25	0,25/ 0,25 / 0,25		0,25 / 0,25 / 0,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	124.0	84.0	0.0	0.0	18.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0,25/ 0,25 / 0,25	0,25/ 0,25 / 0,25			0,25 / 0,25 / 0,25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	1.3	0.0	0.0	0.0
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$)	**25 Setiembre 20**	**28 Setiembre 20**	**29 Setiembre 20**	**30 Setiembre 20**	**01 Octubre 20**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	110.8	-20.0	-25.5	-18.6	98.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	192.7	37.5	204.0	-112.4	53.6
a. Mercado spot con el público	-3.5	-6.8	35.5	-183.0	4.2
i. Compras	224.4	225.4	372.6	271.1	235.0
ii. (-) Ventas	227.9	232.2	337.1	454.1	230.8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	82.7	-221.2	-8.2	162.5	-54.0
i. Pactadas	161.5	317.9	429.1	435.1	165.9
ii. (-) Vencidas	78.8	539.0	437.3	272.6	219.9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	166.3	-144.0	206.9	55.0	-98.0
i. Pactadas	215.3	202.8	532.4	301.8	509.0
ii. (-) Vencidas	49.1	346.8	325.5	246.8	607.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	217.2	286.6	352.7	375.1	307.5
ii. A futuro	60.0	33.0	153.0	64.0	40.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-18.0	-149.2	-88.8	52.6	377.8
i. Compras	42.8	345.6	324.5	245.8	586.0
ii. (-) Ventas	60.8	494.9	413.3	193.2	208.2
f. Efecto de Opciones	-9.6	19.6	-14.3	0.5	1.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	195.6	1.2	145.5	-21.9	58.7
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.5949	3.5916	3.5949	3.5980	3.6064

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera