

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Nov 20	17 Nov 20	18 Nov 20	19 Nov 20	20 Nov 20
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	27 852,8	28 478,0	28 865,9	29 907,1	29 614,6
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	308,0	300,0	117,0	200,0	300,0
Plazo de vencimiento	381,2	493,5	122,0	457,3	789,0
Tasas de interés: Mínima	88,4	29,4	86,4	28,4	95,4
Máxima	0,27	0,24	0,27	0,25	0,27
Promedio	0,28	0,25	0,28	0,25	0,28
Saldo	0,28	0,25	0,28	0,25	0,28
Próximo vencimiento de CD BCRP el 24 de Noviembre del 2020	39 335,2	39 687,0	39 981,0	40 181,0	40 558,0
Vencimiento de CD BCRP al 20 de Nov. del 2020	1 227,2	1 227,2	1 227,2	1 227,2	1 227,2
Vencimiento de CD BCRP al 20 de Nov. del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	1 227,2
ii. Subasta de Repo de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5 358,5	5 358,5	5 358,5	5 358,5	5 358,5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 30 de Noviembre del 2020	300,0	300,0	300,0	300,0	300,0
Vencimiento de Repo de Valores al 20 de Nov. del 2020	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iii. Subasta de Repo de Valores de Cartera de Créditos (RepoCR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de Repo de Cartera General TCOOMPRA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Repo de Valores de Cartera de Créditos (RepoCR Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	382,2	382,2	382,2	382,2	382,2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 18 de Enero del 2021	100,0	100,0	6,8	6,8	6,8
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 20 de Nov. del 2020	100,0	100,0	0,0	0,0	0,0
v. Subasta de Repo de Valores de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (RepoGR)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	53 309,0	53 309,0	53 309,0	53 309,0	53 309,0
vi. Subasta de Repo de Valores de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (RepoGR Especial)					
Garantía para los créditos					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	1 882,2	1 882,2	1 882,2	1 882,2	1 882,2
vii. Subasta de Repo 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 al 20 de Nov. 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 al 20 de Nov. 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 al 20 de Nov. del 2020					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)					
Propuestas recibidas	3 500,1	15 492,5	3 500,0	15 492,2	3 500,0
Plazo de vencimiento	3 622,5	15 492,5	3 638,6	15 457,3	3 458,2
Tasas de interés: Mínima	7,4	1,4	7,4	1,4	7,4
Máxima	0,24	0,24	0,24	0,24	0,24
Promedio	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25
Saldo	0,25	0,25	0,25	0,25	0,25
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 20 de Noviembre del 2020	33 733,3	33 732,9	33 796,2	33 172,9	31 994,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 20 de Nov. del 2020	18 992,6	19 232,6	18 957,5	18 878,0	18 045,8
Vencimiento de Depósitos a Plazo al 20 de Nov. del 2020	30 233,2	26 732,8	22 957,5	18 878,0	31 994,0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (DPLOOTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 500,0	1 500,0	1 500,0	1 500,0	1 000,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de Noviembre del 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	300,0
Vencimiento de Coloc-TP al 20 de Nov. del 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	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 al 20 de Nov. del 2020					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Regulables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas	238,0				
Plazo de vencimiento	92,4				
Tasas de interés: Mínima	0,10				
Máxima	0,20				
Promedio	0,18				
Saldo	6 008,0	7 708,0	7 408,0	7 408,0	7 243,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 20 de Noviembre del 2020	300,0	300,0	165,0	165,0	200,0
Vencimiento de CDR BCRP al 20 de Nov. del 2020	765,0	465,0	165,0	165,0	400,0
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 al 20 de Nov. del 2020					

iv. Compra con compromiso de Reposición de moneda extranjera (Reoq/er)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5.970,0	5.970,0	5.970,0	5.970,0	5.970,0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Febrero del 2021					
Vencimiento de REPO al 20 de Nov. del 2020	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
vii. 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 al 20 de Nov. del 2020					
viii. Compra con compromiso de Reposición de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión al 20 de Nov. del 2020					
ix. Compra con compromiso de Reposición de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución al 20 de Nov. del 2020					
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	165,0				290,0
Propuestas recibidas	165,0				305,0
Plazo de vencimiento	93 d				91 d
Tasas de interés: Mínima	0,12				0,00
Máxima	0,25				0,25
Promedio	0,20				0,16
Saldo	0.430,4	0.430,0	0.430,0	0.430,0	0.429,0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de Noviembre del 2020					
Vencimiento de SC - Venta al 20 de Nov. del 2020	248,5	300,0	300,0	300,0	220,0
	548,5	300,0	300,0	300,0	1.370,2
xi. 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 al 20 de Nov. del 2020					
b. Liquidación de Repo de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)	0,0	0,0	42,0	0,0	3,1
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\$)	0,0	0,0	0,0	6,2	0,0
i. Compras (millones de US\$)				6,2	0,0
ii. Ventas (millones de US\$)					
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	7.322,2	7.126,0	7.318,0	7.372,9	7.841,6
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	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%	0,15%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5.373,0	5.389,5	5.348,0	5.437,9	5.747,2
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	1.948,6	1.736,5	1.969,4	1.928,0	1.794,4
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/ (*)	9.978,6	9.768,8	9.954,8	9.586,5	9.507,3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4,9	4,9	4,7	4,7	4,7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3.723,8	3.810,1	3.484,2	3.426,2	3.348,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,8	1,8	1,7	1,7	1,6
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	- / - / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	- / - / 0,25	0,12 / 0,12 / 0,12	- / - / 0,25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	137,5	158,5	144,0	131,0	147,0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,30 / 0,26	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,25 / 0,25	0,25 / 0,30 / 0,26
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV		37,0	65,0	0,0	55,0
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\$)	13 Noviembre 20	16 Noviembre 20	17 Noviembre 20	18 Noviembre 20	19 Noviembre 20
Flujo de la posición global = a + b) - c) + e + f + g	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable = a + b) - c) + e + f + g	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	-188,1
Flujo de la posición global	22,1	-16,3	-20,5	-19,7	41,3
Flujo de la posición contable	68,8	1,2	27,9	-277,2	