BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	21 Dic 20		22 Dic 20		23 Dic 20		24 Dic 20	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**33 825,5**		**33 923,9**		**33 700,0**		**29 219,3**	
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)	500.0		600.0		700.0	500.0	300.0	
Propuestas recibidas	688.6		1001.4		781.0	834.0	470.0	
Plazo de vencimiento	92 d		91 d		90 d	28 d	89 d	
Tasas de interés: Mínima	0.28		0.26		0.28	0.25	0.28	
Máxima	0.28		0.28		0.28	0.25	0.28	
Promedio	0.28		0.28		0.28	0.25	0.28	
Saldo	39 578.8		39 901.8		39 171.8		39 471.8	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 28 de Diciembre del 2020			1 930.0				1 025.0	
Vencimiento de CD BCRP del 28 al 31 de Dic. de 2020			1 930.0				0.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	5 808.5		6 308.5		6 308.5		6 308.5	
Próximo vencimiento de Reoo de Valores el 15 de Marzo del 2021			750.0				750.0	
Vencimiento Reoo Valores del 28 al 31 de Dic. de 2020			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								
Próximo vencimiento de Reoo de Cartera General								
Vencimiento de Reoo de Cartera General TCCOMPRA								
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	481.4		481.4		481.4		481.4	
Próximo vencimiento de Reoo de Cartera Alternativa el 18 de Enero del 2021			6.8				6.8	
Vencimiento de Reoo de Cartera Alternativa del 28 al 31 de Dic. de 2020			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	53 399.9		53 399.9		53 399.9		53 399.9	
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	1 882.2		1 882.2		1 882.2		1 882.2	
vii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) General - 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 28 al 31 de Dic. de 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 28 al 31 de Dic. de 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 28 al 31 de Dic. de 2020								
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 387.0	20 012.3	3 000.1	19 913.2	4 499.9	18 270.2	1 500.0	16 973.3
Propuestas recibidas	3 387.0	20 012.3	3 512.5	19 913.2	4 675.5	18 270.2	2 123.0	16 973.3
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	11 d	4 d
Tasas de interés: Mínima	0.24	0.24	0.20	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
Promedio	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25
Saldo	36 640.2		36 799.7		35 156.8		35 359.9	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de Diciembre del 2020			24 413.0				26 359.9	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 al 31 de Dic. de 2020			24 413.0				0.0	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	700.0		700.0		200.0		200.0	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de Marzo del 2021			500.0				200.0	
Vencimiento de Coloc-TP del 28 al 31 de Dic. de 2020			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 del 28 al 31 de Dic. de 2020								
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			200.0				200.0	
Propuestas recibidas			270.0				200.0	
Plazo de vencimiento			90 d				90 d	
Tasas de interés: Mínima			0.20				0.20	
Máxima			0.24				0.24	
Promedio			0.22				0.22	
Saldo	6 750.0		6 650.0		6 650.0		6 250.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de Diciembre del 2020			600.0				518.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 28 al 31 de Dic. de 2020			600.0				0.0	
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDCBCRP-NR)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR								
Vencimientos de CD BCRP del 28 al 31 de Dic. de 2020								
xv. Comora con compromiso de Recomora de moneda extranjera (Regular)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	5 970.0		5 970.0		5 970.0		5 970.0	
Próximo vencimiento de Reoo Regular el 3 de Febrero del 2021			500.0				500.0	
Vencimiento de REPO del 28 al 31 de Dic. de 2020			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 28 al 31 de Dic. de 2020								
xvii. Comora con compromiso de Recomora de moneda extranjera (Expansión)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo								
Próximo vencimiento de Reoo Expansion								
Vencimiento de REPO Expansión del 28 al 31 de Dic. de 2020								
xviii. Comora con compromiso de Recomora 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 28 al 31 de Dic. de 2020								
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			200.0	400.0	200.0		48.0	
Propuestas recibidas			683.0	457.0	213.0		48.0	
Plazo de vencimiento			182 d	182 d	182 d		182 d	
Tasas de interés: Mínima			0.07	0.07	0.10		0.22	
Máxima			0.15	0.24	0.25		0.25	
Promedio			0.09	0.17	0.22		0.23	
Saldo	7 129.7		7 729.7		7 838.2		7 886.2	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Diciembre del 2020			91.5				40.0	
Vencimiento de SC - Venta del 28 al 31 de Dic. de 2020			91.5				0.0	
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 28 al 31 de Dic. de 2020								
b. Liquidación de Reoos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP. Circular 0017-2020-BCRP y Circular 002	102.3		0.0		149.3		64.8	
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0		0.0		0.0		61.4	
i. Compras (millones de US$)								
Tipo de cambio promedio								
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		17.0	
Tipo de cambio promedio							3.6110	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0		0.0		1.9		0.0	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.0		1.9		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)								
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		735.6		0.000	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR								
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0		0.0		735.6		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**10 028,5**		**10 210,6**		**10 615,2**		**10 310,8**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones								
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).								
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%		0.0014%		0.0014%		0.0011%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)								
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por nivelación monetaria en moneda nacional								
Tasa de interés								
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	8 199.8		8 741.9		9 008.1		9 106.0	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 828,7**		**1 468,7**		**1 607,1**		**1 204,8**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 541.0		9 478.2		9 387.7		9 323.5	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.6		4.6		4.5		4.5	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 318.2		3 250.5		3 163.4		3 098.5	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.6		1.6		1.5		1.5	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP								
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		0.0		0.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25		- / - / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	301.3		269.5		182.0		85.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.30 / 0.26		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	1.5		11.0		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$)	**18 Diciembre 20**		**21 Diciembre 20**		**22 Diciembre 20**		**23 Diciembre 20**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	14,2		-110,0		134,5		-32,9	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	162,2		151,4		95,5		-144,7	
a. Mercado spot con el público	93,3		135,9		127,7		-76,3	
i. Compras	638,1		693,9		596,2		259,7	
ii. (-) Ventas	542,8		558,0		378,5		327,0	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	56,4		-78,1		-102,6		-105,3	
i. Pactadas	231,9		96,8		80,3		173,9	
ii. (-) Vencidas	175,6		174,9		182,9		369,1	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	204,2		57,5		24,5		-277,6	
i. Pactadas	230,8		108,0		420,6		29,9	
ii. (-) Vencidas	26,7		50,5		396,1		307,5	
d. Operaciones cambiarias interbancarias								
i. Al contado	441,5		216,4		169,7		167,6	
ii. A futuro	196,0		145,0		16,0		11,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-111,5		-109,9		223,0		-104,1	
i. Compras	23,0		42,7		365,8		258,1	
ii. (-) Ventas	134,5		152,6		172,8		362,2	
f. Efecto de Opciones	-0,2		-0,2		0,1		-0,2	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	31,5		-124,7		123,9		3,7	
h. Crédito por nivelación monetaria en moneda extranjera								
Tasa de interés								
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,5974		3,6065		3,6167		3,6122	
(*) Datos preliminares								

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera