BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	25 Ene 21	26 Ene 21	27 Ene 21	28 Ene 21	29 Ene 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**29,368.8**	**30,190.8**	**29,379.9**	**29,150.0**	**28,600.2**
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)	300.0 300.0	300.0 157.0	180.0 92.0	200.0 80.0	248.0
Propuestas recibidas	397.0 350.5	550.0 194.0	230.0 100.0	331.0 80.0	378.0
Plazo de vencimiento	367 d 31 d	366 d 91 d	365 d 90 d	180 d 28 d	179 d
Tasas de interés: Mínima	0.37 0.25	0.37 0.28	0.37 0.28	0.30 0.25	0.30
Máxima	0.37 0.25	0.37 0.28	0.37 0.28	0.31 0.25	0.31
Promedio	0.37 0.25	0.37 0.28	0.37 0.28	0.31 0.25	0.31
Saldo	43,157.8	42,761.8	43,033.8	43,013.8	43,261.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Febrero del 2021	853.0	300.0	300.0	1,639.0	1,639.0
Vencimiento de CD BCRP del 1 al 5 de Feb. de 2021	1,153.0	300.0	300.0	0.0	5,498.7
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6,553.5	6,553.5	6,553.5	6,553.5	6,553.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 15 de Marzo del 2021	750.0	750.0	750.0	750.0	750.0
Vencimiento de Repo Valores del 1 al 5 de Feb. de 2021	0.0	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					
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	777.9	777.9	738.1	737.7	937.2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	199.3	199.3	0.7	0.7	0.7
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 1 al 5 de Feb. de 2021	199.3	199.3	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	53,399.9	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	1,882.2
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 Repo Especial - CDR del 1 al 5 de Feb. de 2021					
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3,500.0 16,378.5	4,000.1 17,691.3	3,960.6 16,155.6	3,185.2 16,358.4	2,999.9 14,800.6
Propuestas recibidas	3,704.1 16,378.5	4,521.3 17,691.3	3,960.6 16,155.6	3,185.2 16,358.4	3,129.2 14,800.6
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	35,774.8	36,137.8	34,562.9	34,004.3	32,446.4
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 1 de Febrero del 2021	21,328.4	21,691.1	20,102.2	19,358.4	18,300.6
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 1 al 5 de Feb. de 2021	32,274.8	28,637.7	23,102.2	19,358.4	32,446.4
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 2 de Marzo del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de Coloc-TP del 1 al 5 de Feb. de 2021	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 1 al 5 de Feb. de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	200.0 Desierta	200.0	50.0	100.0	
Propuestas recibidas	200.0 -.-	220.0	50.0	100.0	
Plazo de vencimiento	91d 91 d	90 d	90 d	90 d	
Tasas de interés: Mínima	0.20 -.-	0.22	0.25	0.25	
Máxima	0.24 -.-	0.25	0.25	0.25	
Promedio	0.22 -.-	0.24	0.25	0.25	
Saldo	6,896.0	7,096.0	6,946.0	6,846.0	6,846.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 4 de Febrero del 2021	200.0	200.0	200.0	300.0	300.0
Vencimiento de CDR BCRP del 1 al 5 de Feb. de 2021	400.0	400.0	200.0	0.0	300.0
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,970.0	6,030.0	6,030.0	6,030.0	6,030.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Febrero del 2021	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de REPO del 1 al 5 de Feb. de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	800.0
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 300.0 200.0 137.0	Desierta 196.0 100.0 132.0	399.9	180.0 100.0 100.0	60.0 199.9 278.0
Propuestas recibidas	255.0 370.0 210.0 137.0	330.0 196.0 150.0 162.0	429.0	180.0 108.0 180.0	60.0 441.0 278.0
Plazo de vencimiento	182 d 91 d 182 d 182 d	59 d 181 d 90 d 181 d	181 d	180 d 180 d 273 d	182 d 273 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	0.20 0.24 0.23 0.23	-.- 0.24 0.25 0.25	0.20	0.25 0.23 0.23	0.25 0.20 0.23
Máxima	0.25 0.25 0.25 0.25	-.- 0.25 0.25 0.25	0.25	0.25 0.25 0.23	0.25 0.24 0.25
Promedio	0.24 0.25 0.24 0.24	-.- 0.25 0.25 0.25	0.24	0.25 0.24 0.23	0.25 0.23 0.25
Saldo	8,386.2	8,514.1	8,743.0	8,823.1	9,060.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Febrero del 2021	300.1	171.0	299.9	300.1	125.0
Vencimiento de SC - Venta del 1 al 5 de Feb. de 2021	1,071.1	771.0	600.0	300.1	125.0
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 1 al 5 de Feb. de 2021					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	255.1	298.9	621.3	368.1	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	70.0	82.0	170.0	101.0	0.0
Tipo de cambio promedio	3.6449	3.6452	3.6545	3.6444	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	14.3
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	14.3
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8,435.2**	**7,543.5**	**8,320.4**	**8,858.3**	**10,551.7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0013%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	7,098.6	6,046.0	6,835.9	7,623.0	9,289.8
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,336.6**	**1,497.5**	**1,484.5**	**1,235.3**	**1,261.9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,753.4	8,709.0	8,680.3	8,648.1	8,600.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2	4.2	4.2	4.2	4.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,420.6	2,380.9	2,354.2	2,322.6	2,276.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.2	1.1	1.1	1.1	1.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	160.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	139.0	125.0	110.5	110.5	118.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	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	100.0	50.0	32.5	65.0	206.0
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$)	**22 Enero 21**	**25 Enero 21**	**26 Enero 21**	**27 Enero 21**	**28 Enero 21**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	63.0	-28.4	-17.2	-20.0	-148.5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	250.7	184.1	143.3	103.1	-133.8
a. Mercado spot con el público	85.0	45.0	6.9	-8.8	-181.5
i. Compras	328.8	445.5	387.7	446.0	392.2
ii. (-) Ventas	243.8	400.6	380.8	454.8	573.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	211.4	27.0	-85.4	-131.9	112.2
i. Pactadas	307.8	187.1	132.4	233.4	296.9
ii. (-) Vencidas	96.4	160.1	217.8	365.4	184.7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	393.4	322.0	109.1	45.1	148.0
i. Pactadas	556.0	653.3	191.4	351.8	202.3
ii. (-) Vencidas	162.6	331.3	82.3	306.7	54.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	402.9	318.3	343.2	593.2	386.7
ii. A futuro	64.0	46.0	184.0	135.0	10.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	70.6	183.6	-134.8	-69.4	-146.7
i. Compras	160.7	330.0	82.0	282.5	29.5
ii. (-) Ventas	90.1	146.5	216.8	351.9	176.3
f. Efecto de Opciones	0.3	-0.6	-0.1	-8.1	-0.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	155.2	209.8	169.9	184.7	85.2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6338	3.6447	3.6454	3.6522	3.6449
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera