BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	19 Abr 21	20 Abr 21	21 Abr 21	22 Abr 21	23 Abr 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,959.6**	**21,952.3**	**21,820.4**	**20,032.7**	**18,764.4**
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)					
Propuestas recibidas	185.0	40.0 200.0	300.0	52.0	100.1
Plazo de vencimiento	223.0	45.0 205.0	374.0	52.0	134.4
Tasas de interés: Mínima	80 d	178 d 34 d	33 d	32 d	31 d
Máxima	0.28	0.31 0.25	0.25	0.24	0.25
Promedio	0.28	0.31 0.25	0.25	0.25	0.25
Saldo	42,901.9	43,141.9	43,441.9	43,493.9	43,394.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 26 de Abril del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	299.9
Vencimiento de CD BCRP del 26. al 30 de Abr. de 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	673.9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3,713.5	3,428.5	3,428.5	3,028.5	2,528.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Abril del 2021	285.0	400.0	400.0	500.0	500.0
Vencimiento de Repo Valores del 26. al 30 de Abr. de 2021	1,185.0	600.0	600.0	500.0	600.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
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					
Vencimiento de Repo de Cartera General el 19 de Abril del 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,685.6	1,685.6	1,685.6	1,685.6	1,680.2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 30 de Abril del 2021	0.5	0.5	0.5	0.5	8.3
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 26. al 30 de Abr. de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	8.3
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	53,900.0	53,900.0	53,900.0	53,900.0	53,900.0
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 26. al 30 de Abr. 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 CDV BCRP del 26. al 30 de Abr. 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 26. al 30 de Abr. de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 149.0 13 700.3	3 500.1 13 202.5	3 130.8 13 802.5	2 057.7 13 597.2	993.9 13 785.2
Propuestas recibidas	3 149.0 13 846.9	3 546.4 13 202.5	3 130.8 13 802.5	2 057.7 13 597.2	993.9 13 785.2
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 0.23	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	29,849.3	28,851.7	28,582.5	27,434.8	26,616.7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 26 de Abril del 2021	17,700.2	17,202.5	16,802.6	15,597.2	16,934.2
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 26. al 30 de Abr. de 2021	26,700.3	22,202.6	18,802.6	15,597.2	26,616.7
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
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 Coloc-TP					
Vencimiento de Coloc-TP del 26. al 30 de Abr. de 2021					
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 26. al 30 de Abr. de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	95.0 70.0	20.0 90.0 220.0	40.0 495.0 110.0	100.0 200.0 110.0	50.0 180.0 50.0
Propuestas recibidas	95.0 70.0	20.0 90.0 220.0	40.0 495.0 110.0	100.0 200.0 110.0	50.0 180.0 50.0
Plazo de vencimiento	91 d 91 d	91 d 91 d 91 d	91 d 91 d 92 d	92 d 92 d 92 d	91 d 91 d 91 d
Tasas de interés: Mínima	0.25 0.25	0.25 0.25 0.23	0.25 0.25 0.23	0.25 0.24 0.25	0.25 0.25 0.25
Máxima	0.25 0.25	0.25 0.25 0.23	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 0.24	0.25 0.25 0.24	0.25 0.25 0.25	0.25 0.25 0.25
Saldo	6,596.0	6,766.0	6,755.0	6,655.0	6,935.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Abril del 2021	160.0	656.0	510.0	400.0	400.0
Vencimiento de CDR BCRP del 26. al 30 de Abr. de 2021	1,596.0	1,166.0	510.0	0.0	650.0
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 26. al 30 de Abr. de 2021					
xv. Comera con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,562.0	1,562.0	1,622.0	1,622.0	1,622.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 12 de Mayo del 2021	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de REPO del 26. al 30 de Abr. de 2021	0.0	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 Repo					
Vencimiento de REPO del 26. al 30 de Abr. 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 26. al 30 de Abr. de 2021					
xviii. Comera 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 26. al 30 de Abr. de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	267.0 205.0 50.0	300.0 300.0 188.0	60.0 317.0 227.0	178.0 237.0 460.0	77.0 200.0 120.0 300.0
Propuestas recibidas	267.0 205.0 50.0	300.0 339.0 188.0	60.0 317.0 227.0	178.0 237.0 460.0	77.0 200.0 120.0 318.0
Plazo de vencimiento	365 d 91 d 365 d	91 d 365 d 300 d	365 d 365 d 92 d	365 d 365 d 365 d	367 d 367 d 367 d 367 d
Tasas de interés: Mínima	0.23 0.25 0.25	0.25 0.23 0.22	0.25 0.23 0.22	0.23 0.23 0.22	0.23 0.25 0.25 0.24
Máxima	0.25 0.25 0.25	0.25 0.25 0.25	0.25 0.25 0.25	0.25 0.24 0.25	0.25 0.25 0.25 0.25
Promedio	0.25 0.25 0.25	0.25 0.24 0.24	0.25 0.24 0.24	0.24 0.24 0.25	0.24 0.25 0.25 0.24
Saldo	50,594.0	51,183.0	51,743.0	52,586.0	53,277.0
Próximo vencimiento de SC - Venta del 26 de Abril del 2021	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de SC - Venta del 26. al 30 de Abr. de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	400.0
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 26. al 30 de Abr. de 2021					
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	18.9	155.3
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	5.0	41.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	3.7750	3.7869
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	-0.3	36.5	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.3	116.5	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.3	80.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de TD BCRP, TD BCRPxUSD y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de TD BCRP y TD BCRPxUSD					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,760.3**	**4,675.7**	**3,942.1**	**3,997.8**	**3,450.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Comera temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Comera temporal directa de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,259.8	2,730.2	2,154.7	2,228.8	2,081.3
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,500.5**	**1,945.5**	**1,787.4**	**1,739.0**	**1,368.7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,816.5	9,785.9	9,676.3	9,587.1	9,506.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	4.0	4.9	4.8	4.8	4.7
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,667.8	3,639.2	3,532.5	3,445.8	3,369.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	1.8	1.8	1.7	1.7	1.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	145.0	43.0
Tasas de interés Mínima / Máxima / TIBO	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25	0.20 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	55.0	0.0	0.0	50.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.00 / 0.00 / 0.00	0.25 / 0.30 / 0.29	0.00 / 0.00 / 0.00	0.00 / 0.00 / 0.00	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	50.0	238.0	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. Operciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$	**Abr 16, 2021**	**Abr 19, 2021**	**Abr 20, 2021**	**Abr 21, 2021**	**Abr 22, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.ii + e + f + g	-31.1	95.9	81.9	101.7	88.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-34.3	-42.7	94.6	-35.3	-304.5
a. Mercado spot con el público	-59.1	-38.4	50.1	-42.1	-263.2
i. Compras	333.1	300.5	422.1	284.3	322.6
ii. (-) Ventas	392.2	338.9	372.0	326.4	585.8
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	76.9	56.1	-174.1	44.4	-367.4
i. Pactadas	350.0	275.1	148.4	160.1	371.9
ii. (-) Vencidas	270.1	178.9	272.5	93.7	639.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	75.2	95.0	102.2	80.8	-431.0
i. Pactadas	209.1	239.9	487.1	593.6	394.0
ii. (-) Vencidas	133.9	144.8	384.9	512.8	824.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	383.9	248.1	429.6	350.0	539.6
ii. A Plazo	149.1	154.1	79.1	432.1	87.0
e. Opera ions spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	159.1	34.4	110.1	432.1	167.0
i. Compras	79.4	123.4	373.3	512.3	823.0
ii. (-) Ventas	208.5	157.8	263.2	80.2	925.9
f. Efecto de Opciones	-1.4	-4.4	-0.2	0.3	6.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	17.6	137.7	260.7	145.0	180.0
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6323	3.6784	3.6854	3.7045	3.7614

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera