BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	03 May 21	04 May 21	05 May 21	06 May 21	07May 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**23,234.4**	**24,370.9**	**23,982.1**	**23,883.4**	**25,154.7**
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)		110.0			499.9
Propuestas recibidas		120.0			560.0
Plazo de vencimiento		34 d			31 d
Tasas de interés: Mínima		0.25			0.25
Máxima		0.25			0.25
Promedio		0.25			0.25
Saldo	42.720.1	41.810.1	41.810.1	41.410.1	41.803.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 10 de Mayo del 2021	1.020.0	400.0	400.0	107.0	300.0
Vencimiento de CD BCRP del 07. al 07 de May. de 2021	1.420.0	400.0	400.0	0.0	2.241.6
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.928.5	1.928.5	1.928.5	1.928.5	1.928.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 2 de Agosto del 2021	1.9	1.9	1.9	1.9	1.9
Vencimiento de Repo Valores del 07. al 07 de May. 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General el 7 de Mayo del 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.678.6	1.678.6	1.678.6	1.678.6	1.676.5
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	9.2	9.2	9.2	9.2	0.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 07. al 07 de May. de 2021	9.2	9.2	9.2	9.2	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 07. al 07 de May. 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 07. al 07 de May. 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 07. al 07 de May. de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 518.0; 13 384.0	2 499.9; 14 749.8	2 999.8; 14 859.3	2 000.0; 15 739.4	2 999.9; 15 589.5
Propuestas recibidas	1 518.0; 13 384.0	3 103.1; 15 463.8	3 295.7; 14 859.3	3 034.8; 15 739.4	3 788.0; 15 589.5
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	0.25; 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	22.525.2	24.672.9	25.394.2	26.274.1	10.499.6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 10 de Mayo del 2021	15.102.0	17.137.8	16.859.5	17.256.4	2.499.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 07. al 07 de May. de 2021	21.007.2	20.655.0	18.376.5	17.256.4	10.499.6
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)				1000.0	1000.0
Propuestas recibidas				2769.0	1934.5
Plazo de vencimiento				186 d	192 d
Tasas de interés: Mínima				0.92	0.30
Máxima				0.92	1.80
Promedio				0.92	0.65
Saldo	0.0	0.0	0.0	1.000.0	2.000.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP				1000.0	1.000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 07. al 07 de May. de 2021				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 07. al 07 de May. de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	10.0; Desierta; 200.0	150.0; 160.0	Desierta		
Propuestas recibidas	10.0; -.-; 200.0	150.0; 160.0	-.-		
Plazo de vencimiento	91 d; 91 d; 91 d	92 d; 92 d	92 d		
Tasas de interés: Mínima	0.25; -.-; 0.24	0.25; 0.25	-.-		
Máxima	0.25; -.-; 0.24	0.25; 0.25	-.-		
Promedio	0.25; -.-; 0.24	0.25; 0.25	-.-		
Saldo	6.275.0	6.385.0	6.285.0	6.285.0	6.185.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de Mayo del 2021	200.0	100.0	100.0	100.0	300.0
Vencimiento de CDR BCRP del 07. al 07 de May. de 2021	300.0	100.0	0.0	0.0	540.0
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 07. al 07 de May. de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.657.0	1.657.0	1.657.0	1.657.0	1.657.0
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 07. al 07 de May. de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	50.0
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 07. al 07 de May. 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 07. al 07 de May. 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 07. al 07 de May. de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	60,0; 100,0; Desierta; Desierta	Desierta; Desierta; 180,0		38,0; 40,0	300,0; 200,0
Propuestas recibidas	60.0; 100.0; -.-; -.-	-.-; -.-; 180.0		38.0; 40.0	300.0; 201.0
Plazo de vencimiento	364 d; 364 d; 364 d; 364 d	365 d; 365 d; 365 d		365 d; 365 d	364 d; 364 d
Tasas de interés: Mínima	0.25; 0.25; -.-; -.-	0.00; 0.00; 0.25		0.25; 0.25	0.20; 0.23
Máxima	0.25; 0.25; -.-; -.-	0.00; 0.00; 0.25		0.25; 0.25	0.20; 0.23
Promedio	0.25; 0.25; -.-; -.-	0.00; 0.00; 0.25		0.25; 0.25	0.20; 0.23
Saldo	33.855.9	33.735.9	33.735.9	33.813.9	34.313.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Mayo del 2021	300.0	199.9	199.9	199.9	199.9
Vencimiento de SC - Venta del 07. al 07 de May. de 2021	300.0	0.0	0.0	0.0	199.9
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 07. al 07 de May. 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	305.4	452.8	72.7	0.0	122.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	80.0	118.0	19.0	0.0	32.0
Tipo de cambio promedio	3.8171	3.8374	3.8280		3.8125
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0		
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0		
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8.027.0**	**6.558.1**	**6.050.4**	**7.144.4**	**5.944.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	763.2	1.503.7	1.556.7	2.239.5	2.086.0
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7,263.8**	**5,054.4**	**4,493.7**	**4,904.9**	**3,858.3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8.928.0	10.812.1	10.420.9	10.342.6	10.486.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.5	5.5	5.3	5.3	5.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2.822.3	4.758.9	4.376.1	4.302.3	4.447.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.4	2.4	2.2	2.2	2.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	80.0	141.0	195.0	189.0	189.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.30 / 0.28	0.25 / 0.35 / 0.29	0.30 / 0.35 / 0.31	0.30 / 0.35 / 0.35	0.30 / 0.35 / 0.35
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	33.0	3.0	0.0	80.0	80.0
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$)	**Abr 30, 2021**	**May 03, 2021**	**May 04, 2021**	**May 05, 2021**	**May 06, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	137.8	-167.1	-8.3	-125.1	-63.0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	2.6	163.7	220.2	-92.8	-107.1
a. Mercado spot con el público	20.4	174.6	79.4	-75.4	-72.9
i. Compras	352.9	354.0	329.9	282.2	362.6
ii. (-) Ventas	332.5	179.4	250.5	357.6	435.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	132.5	-17.2	-132.0	-173.5	-158.2
i. Pactadas	210.1	122.1	153.7	161.8	255.6
ii. (-) Vencidas	77.6	139.3	285.7	335.4	413.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	27.3	190.7	80.5	-147.8	-182.0
i. Pactadas	236.5	430.7	267.0	202.0	398.1
ii. (-) Vencidas	209.2	240.0	186.5	349.8	580.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	309.8	282.4	275.1	324.0	465.5
ii. A futuro	47.0	43.0	9.0	40.0	37.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	124.4	95.1	-93.6	15.7	151.8
i. Compras	195.9	230.1	148.1	349.4	552.9
ii. (-) Ventas	71.5	135.0	241.7	333.6	401.1
f. Efecto de Opciones	30.1	13.2	18.7	-6.6	0.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-10.7	-141.3	100.4	-18.7	0.6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7884	3.8134	3.8337	3.8250	3.8170

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera