BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	17 May 21	18 May 21	19 May 21	20 May 21	21 May 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**23,816.1**	**24,364.9**	**22,252.4**	**21,598.7**	**20,031.8**
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)	189.5 65.0	105.0	122.0	100.0 292.0	216.7
Propuestas recibidas	199.5 65.0	165.0	187.0	249.0 302.0	316.7
Plazo de vencimiento	182 d 28 d	181 d	180 d	179 d 34 d	178 d
Tasas de interés: Mínima	0.31 0.25	0.31	0.31	0.31 0.24	0.31
Máxima	0.31 0.25	0.31	0.31	0.31 0.25	0.31
Promedio	0.31 0.25	0.31	0.31	0.31 0.25	0.31
Saldo	42.096.0	42.201.0	42.323.0	42.715.0	42.931.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 24 de Mayo del 2021	1.414.1	1.414.1	1.414.1	1.414.1	1.414.1
Vencimiento de CD BCRP del 24 al 28 de mayo de 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	1.414.1
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 24 al 28 de mayo de 2019	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 21 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	1.876.2	1.876.2	2.066.5	2.066.5	2.064.6
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 28 de Mayo del 2021	6.8	6.8	6.8		6.0
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 24 al 28 de mayo de 2019	6.8	6.8	6.8		6.0
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 24 al 28 de mayo de 2019					
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 24 al 28 de mayo de 2019					
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 24 al 28 de mayo de 2019					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 499.9 14 769.3	2 999.7 14 569.4	2 559.0 13 129.9	2 714.2 14 183.0	1 603.2 12 711.0
Propuestas recibidas	3 724.8 14 769.3	3 259.0 14 569.4	2 559.0 13 129.9	2 714.2 14 183.0	1 603.2 12 711.0
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	29.691.0	29.490.8	27.947.9	28.757.3	26.087.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 24 de Mayo del 2021	17.769.3	17.231.8	16.087.8	16.984.5	16.210.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 24 al 28 de mayo de 2019	26.191.1	22.991.2	18.889.3	16.984.5	26.087.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2.820.5	2.820.5	2.820.5	2.820.5	2.820.5
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 17 de Agosto del 2021	275.0	275.0	275.0	275.0	275.0
Vencimiento de Coloc-TP del 24 al 28 de mayo de 2019	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 24 al 28 de mayo de 2019					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	50.0 92.0 75.0 80.0	Desierta Desierta 40.0 300.0 300.0 132.0	150.0		100.0 100.0
Propuestas recibidas	50.0 92.0 75.0 80.0	-.- -.- 40.0 336.0 355.0 132.0	150.0		100.0 100.0
Plazo de vencimiento	92 d 92 d 92 d 92 d	92 d 92 d 92 d 92 d 62 d 94 d	93 d		91 d 63 d
Tasas de interés: Mínima	0.25 0.25 0.25 0.25	-.- -.- 0.25 0.24 0.20 0.23	0.23		0.24 0.24
Máxima	0.25 0.25 0.25 0.25	-.- -.- 0.25 0.25 0.25 0.25	0.23		0.24 0.25
Promedio	0.25 0.25 0.25 0.25	-.- -.- 0.25 0.25 0.24 0.24	0.23		0.24 0.25
Saldo	5.936.0	5.978.0	6.103.0	6.103.0	6.303.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 24 de Mayo del 2021	730.0	25.0	40.0	40.0	40.0
Vencimiento de CDR BCRP del 24 al 28 de mayo de 2019	755.0	25.0	0.0	0.0	310.0
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 24 al 28 de mayo de 2019					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.692.0	1.692.0	1.692.0	1.692.0	1.692.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 10 de Agosto del 2021	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de REPO del 24 al 28 de mayo de 2019	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 24 al 28 de mayo de 2019					
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 24 al 28 de mayo de 2019					
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 24 al 28 de mayo de 2019					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	Desierta				
Propuestas recibidas	-.-				
Plazo de vencimiento	365 d				
Tasas de interés: Mínima	-.-				
Máxima	-.-				
Promedio	-.-				
Saldo	34.157.0	34.157.0	34.157.0	34.157.0	34.157.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Junio del 2021	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de SC - Venta del 24 al 28 de mayo de 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)	25.0	40.0			82.0
Propuestas recibidas	25.0	40.0			82.0
Plazo de vencimiento	7 d	14 d			14 d
Tasas de interés: Mínima	0.31	0.31			0.31
Máxima	0.31	0.31			0.35
Promedio	0.31	0.31			0.33
Saldo	1.354.9	1.394.9	1.394.9	1.294.9	1.376.9
Próximo vencimiento de RED el 24 de Mayo del 2021	100.0	1.394.9	100.0	100.0	225.0
Vencimiento de RED del 24 al 28 de mayo de 2019	100.0	100.0	100.0	0.0	1.254.9
b. Liquid. Repos 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	0.0	46.9
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	12.5
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	3.7550
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	3.3	0.1	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	3.3	0.1	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4.995.4**	**4.918.8**	**6.091.5**	**4.309.5**	**5.253.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2.956.2	2.996.3	3.486.7	2.563.8	3.203.2
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,039.2**	**1,922.5**	**2,604.8**	**1,745.7**	**2,050.7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9.237.1	9.196.8	9.127.6	9.140.2	9.035.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.7	4.6	4.6	4.6	4.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3.159.3	3.115.5	3.046.6	3.058.6	2.955.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.6	1.6	1.5	1.5	1.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	80.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.00 / 0.00 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	194.0	156.0	105.0	196.0	284.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.30 / 0.29	0.25 / 0.30 / 0.28	0.25 / 0.30 / 0.28	0.25 / 0.30 / 0.29	0.25 / 0.30 / 0.30
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	30.0	21.5	0.0	120.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			20.0 / 0.31		
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**May 14, 2021**	**May 17, 2021**	**May 18, 2021**	**May 19, 2021**	**May 20, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-53.1	50.0	-74.9	14.0	160.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	148.0	-34.3	80.9	9.9	-24.0
a. Mercado spot con el público	126.9	91.2	86.4	0.5	15.2
i. Compras	613.1	413.3	345.2	329.3	485.8
ii. (-) Ventas	486.2	322.2	258.8	328.8	470.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-39.7	106.6	-24.7	115.1	42.5
i. Pactadas	132.0	447.3	227.4	267.4	342.0
ii. (-) Vencidas	171.8	340.7	252.1	152.3	299.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	176.3	12.4	132.3	112.1	-131.9
i. Pactadas	500.2	480.1	460.8	242.2	161.2
ii. (-) Vencidas	323.9	467.7	328.5	130.1	293.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	446.6	423.9	266.0	453.6	363.1
ii. A futuro	80.0	16.0	32.0	61.0	72.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	108.4	89.6	64.1	-44.3	-36.0
i. Compras	267.7	415.0	302.0	107.8	255.2
ii. (-) Ventas	159.3	325.4	237.8	152.1	291.2
f. Efecto de Opciones	14.8	0.1	1.2	1.1	10.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	64.8	-98.0	6.7	31.4	-9.5
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6766	3.7094	3.7317	3.7453	3.7361
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera