BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	16 Ago 21	17 Ago 21	18 Ago 21	19 Ago 21	20 Ago 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**27,830.2**	**25,929.7**	**25,614.4**	**21,342.8**	**21,292.7**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias operables del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)		101.0	200.0	90.0	3.0
Propuestas recibidas		133.0	223.5	90.0	40.0
Plazo de vencimiento		31 d	30 d	29 d	90 d
Tasas de interés: Mínima		0.49	0.48	0.50	0.50
Máxima		0.50	0.50	0.50	0.53
Promedio		0.50	0.50	0.50	0.52
Saldo	35,681.7	35,782.7	34,782.7	34,872.7	34,875.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 24 de Agosto del 2021	1,300.0	1,300.0	2,320.0	2,320.0	2,320.0
Vencimiento de CD BCRP del 23 al 27 de ago de 2021	1,300.0	1,300.0	0.0	0.0	2,320.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9,666.0	9,666.0	9,666.0	8,666.0	8,666.0
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 3 de Setiembre del 2021	60.0	60.0	1,000.0	60.0	60.0
Vencimiento de Reso Valores del 23 al 27 de ago de 2021	0.0	0.0	1,000.0	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 del 23 al 27 de ago de 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,837.5	2,837.5	2,837.5	2,837.5	2,837.5
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativo el 13 de Setiembre del 2021	2.5	2.5	2.5	2.5	2.5
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 23 al 27 de ago de 2021	0.0	0.0	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 (Esencial)					
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 Esencial - CDR					
Vencimiento de Reso Esencial - CDR del 23 al 27 de ago de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)			100.0		50.0
Propuestas recibidas			130.0		50.0
Plazo de vencimiento			92 d		90 d
Tasas de interés: Mínima			0.00		0.00
Máxima			0.00		0.00
Promedio			0.00		0.00
Saldo			100.0	100.0	150.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de noviembre de 2021			0.0	100.0	150.0
Vencimientos de CDV BCRP del 23 al 27 de ago de 2021					0.0
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 23 al 27 de ago de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000.0 21 000.2	1 999.8 19 740.1	1 999.9 18 093.5	2 000.2 15 000.3	1 500.2 13 513.9
Propuestas recibidas	2 496.0 21 572.9	2 676.8 19 740.1	2 006.0 18 093.5	2 049.0 16 140.3	1 606.0 13 513.9
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	0.25 0.25	0.48 0.25	0.49 0.48	0.45 0.42	0.49 0.42
Máxima	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50
Promedio	0.49 0.42	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50
Saldo	27,416.3	27,655.9	27,570.2	26,000.1	23,014.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 23 de Agosto del 2021	21,500.3	20,179.1	18,570.6	18,000.2	15,513.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 23 al 27 de ago de 2021	25,416.3	23,656.1	21,570.5	18,000.2	23,014.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,939.5	4,664.5	4,664.5	4,664.5	4,664.5
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 17 de Setiembre del 2021	376.0	163.2	163.2	163.2	163.2
Vencimiento de Coloc-TP del 23 al 27 de ago de 2021	376.0	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 23 al 27 de ago de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	120.0	150.0	40.0 110.0 125.0	25.0	15.0 150.0
Propuestas recibidas	120.0	150.0	40.0 110.0 125.0	25.0	15.0 150.0
Plazo de vencimiento	60 d	62 d	30 d 30 d 30 d	32 d	31 d 32 d
Tasas de interés: Mínima	0.60	0.58	0.59 0.60 0.59	0.60	0.60 0.60
Máxima	0.60	0.59	0.59 0.60 0.60	0.60	0.60 0.60
Promedio	0.60	0.58	0.59 0.60 0.60	0.60	0.60 0.60
Saldo	7,580.0	7,403.0	7,338.0	7,365.0	7,146.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 23 de Agosto del 2021	327.0	340.0	382.0	382.0	20.0
Vencimiento de CDR BCRP del 23 al 27 de ago de 2021	1,049.0	722.0	382.0	382.0	350.0
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 23 al 27 de ago de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,872.0	1,872.0	1,872.0	1,872.0	1,872.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 27 de Setiembre del 2021	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de ago 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 Reso					
Vencimiento de REPO del 23 al 27 de ago 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 23 al 27 de ago 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 Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 23 al 27 de ago de 2021					
<u>xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP</u>			<u>40.0 100.0</u>	<u>267.0 110.0 415.0</u>	<u>40.0 200.0 140.0</u>
Propuestas recibidas			40.0 100.0	267.0 310.0 465.0	60.0 270.0 140.0
Plazo de vencimiento			61 d 92 d	32 d 92 d 32 d	31 d 32 d 32 d
Tasas de interés: Mínima			0.60 0.60	0.58 0.60 0.60	0.60 0.60 0.60
Máxima			0.60 0.60	0.60 0.60 0.60	0.60 0.60 0.60
Promedio			0.60 0.60	0.59 0.60 0.60	0.60 0.60 0.60
Saldo	25,847.0	25,847.0	25,406.9	25,298.9	25,540.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Setiembre del 2021	580.1	580.1	900.0	138.0	379.5
Vencimiento de SC - Venta del 23 al 27 de ago de 2021	1,618.1	1,618.1	1,038.0	138.0	0.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (REDI)	155.0	200.0			
Propuestas recibidas	155.0	200.0			
Plazo de vencimiento	15 d	14 d			
Tasas de interés: Mínima	0.33	0.40			
Máxima	0.37	0.40			
Promedio	0.35	0.40			
Saldo	1,554.0	1,354.0	1,154.0	1,049.0	999.0
Próximo vencimiento de REDI el 23 de Agosto del 2021	400.0	200.0	105.0	50.0	339.0
Vencimiento de REDI del 23 al 27 de ago de 2021	755.0	355.0	155.0	50.0	644.0
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	4.1	12.3	483.1	636.8	1,057.2
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	1.0	3.0	118.0	155.0	257.0
Tipo de cambio promedio	4.0830	4.0920	4.0939	4.1081	4.1135
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	10.7	0.0	0.0	0.0	0.3
i. Compras (millones de US$)	10.7	0.0	0.0	0.0	0.3
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Vencimiento)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,705.9**	**3,926.5**	**4,462.9**	**3,690.5**	**5,003.4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0029%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	9,088.2	9,466.2	9,469.5	9,435.8	8,959.0
Tasa de interés	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,617.7**	**1,260.3**	**1,963.4**	**1,154.9**	**745.5**
a. Encaje de aceras en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	9,628.7	9,449.9	9,317.8	9,206.4	9,153.3
b. Encaje de aceras en moneda nacional promedio acumulado (% del TOMN) (*)	4.7	4.6	4.6	4.5	4.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,487.7	3,309.6	3,175.9	3,149.1	3,009.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOMN) (*)	1.7	1.6	1.6	1.5	1.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	450.0	150.0	275.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	41.0	203.0	0.0	226.0	267.0
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	51.6	0.0	0.0	10.0	1.4
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$)	**Ago 13, 2021**	**Ago 16, 2021**	**Ago 17, 2021**	**Ago 18, 2021**	**Ago 19, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	61.9	38.7	-70.3	-28.4	-38.5
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-251.2	22.1	255.4	270.9	292.6
a. Mercado spot con el público	-219.0	43.0	344.3	166.7	119.8
i. Compras	422.0	355.0	635.4	424.2	436.2
ii. (-) Ventas	641.0	312.0	291.1	257.4	316.5
b. Compras forward y swaps al público (con y sin entrega)	194.5	-21.9	18.4	-25.3	-340.9
i. Pactadas	336.9	164.8	395.4	185.6	264.1
ii. (-) Vencidas	142.3	186.7	377.0	210.9	605.1
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	217.6	-18.5	321.4	148.9	-64.1
i. Pactadas	300.6	173.9	498.9	243.1	362.3
ii. (-) Vencidas	83.1	192.4	147.5	94.2	426.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	397.4	273.6	613.6	332.9	392.6
ii. A futuro	48.0	110.0	0.0	72.8	30.0
e. Operaciones sool asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-56.6	3.5	-267.1	-108.7	-158.4
i. Compras	81.5	185.5	106.0	90.0	414.2
ii. (-) Ventas	138.1	182.1	373.0	198.6	572.6
f. Efecto de Decisiones	2.3	35.1	-22.8	-0.3	-0.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	299.0	-18.7	-51.3	-28.6	98.6
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0740	4.0761	4.0879	4.0937	4.1104

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera