BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	22 Feb 21		23 Feb 21		24 Feb 21		25 Feb 21		26 Feb 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**24,769.8**		**27,295.0**		**26,664.3**		**26,758.7**		**25,018.8**	
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)	300.0		200.0	300.0	500.1	262.0	500.0	161.2	127.0	299.9
Propuestas recibidas	527.0		367.0	450.0	630.0	282.0	680.0	191.2	127.0	391.0
Plazo de vencimiento	183 d		182 d	90 d	181 d	89 d	180 d	27 d	363 d	179 d
Tasas de interés: Mínima	0.31		0.30	0.25	0.31	0.27	0.31	0.25	0.36	0.31
Máxima	0.31		0.31	0.28	0.31	0.28	0.31	0.25	0.37	0.31
Promedio	0.31		0.31	0.28	0.31	0.28	0.31	0.25	0.37	0.31
Saldo	43,459.8			41,775.8		42,577.9		42,589.1		43,043.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Marzo del 2021	2,360.0			680.0		680.0		3,061.7		3,061.7
Vencimiento de CD BCRP del 1 al 5 de Mar. de 2021	3,040.0			680.0		680.0		3,061.7		3,061.7
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		6,178.5		6,178.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores al 1º de Marzo del 2021	760.0			760.0		375.0		375.0		375.0
Vencimiento de Repo Valores del 1 al 5 de Mar. de 2021	0.0			0.0		375.0		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	1,084.3			1,084.3		1,084.3		1,277.1		1,264.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo al 4 de Marzo del 2021	3.6			3.6		3.6		5.6		5.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 1 al 5 de Mar. de 2021	3.6			27.1		27.1		5.6		5.6
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 Mar. 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 Mar. 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 Mar. de 2021										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	5 000.1	15 759.0	4 999.0	18 072.2	4 237.0	17 955.1	4 546.0	16 846.6	3 534.0	16 075.0
Propuestas recibidas	5 107.0	15 759.0	5 320.0	18 072.2	4 237.0	17 955.1	4 546.0	16 846.6	3 534.0	16 075.0
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	38,743.1		41,056.1		40,191.3		18,783.0		38,392.0	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo al 1 de Marzo del 2021	20,759.1		23,056.9		21,954.3		5,000.1		21,075.1	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 1 al 5 de Mar. de 2021	33,743.0		31,056.1		26,954.3		18,783.0		38,392.0	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación										
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 Mar. de 2021	0.0		0.0		0.0		200.0		200.0	
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 Mar. de 2021										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			40.0				200.0	70.0		
Propuestas recibidas			40.0				270.0	70.0		
Plazo de vencimiento			90 d				89 d	89 d		
Tasas de interés: Mínima			0.25				0.19	0.24		
Máxima			0.25				0.19	0.24		
Promedio			0.25				0.19	0.24		
Saldo	8,271.0		8,011.0		8,011.0		7,811.0		7,811.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP al 1 de Marzo del 2021	360.0		130.0		130.0		167.0		167.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 1 al 5 de Mar. de 2021	770.0		490.0		490.0		367.0		367.0	
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 Mar. de 2021										
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	5,230.0		5,230.0		5,230.0		5,230.0		5,230.0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Marzo del 2021	200.0		200.0		200.0		200.0		200.0	
Vencimiento de REPO del 1 al 5 de Mar. de 2021	0.0		0.0		0.0		400.0		400.0	
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 Mar. de 2021										
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Excepcional)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo										
Próximo vencimiento de Repo Excepcion										
Vencimiento de REPO Excepción del 1 al 5 de Mar. 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 Sustitución										
Vencimiento de REPO Sustitución del 1 al 5 de Mar. de 2021										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	95.0	30.0	81.0	121.0	33.0	Pendiente	200.0	8.0	Pendiente	36.5	Pendiente
Propuestas recibidas	95.0	30.0	81.0	121.0	33.0		257.0	8.0	--	36.5	--
Plazo de vencimiento	273 d	273 d	273 d	273 d	273 d	273 d	272 d	272 d	181 d	273 d	273 d
Tasas de interés: Mínima	0.25	0.25	0.25	0.23	0.24	--	0.22	0.25	--	0.25	--
Máxima	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	--	0.25	0.25	--	0.25	--
Promedio	0.25	0.25	0.25	0.23	0.24	--	0.23	0.25	--	0.25	--
Saldo	10,379.6			10,479.6		10,479.6		10,687.6		10,724.1	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 15 de Marzo del 2021	135.0			50.0		50.0		50.0		50.0	
Vencimiento de SC - Venta del 1 al 5 de Mar. de 2021	135.0			0.0		0.0		0.0		0.0	
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 1 al 5 de Mar. de 2021										
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	321.5		58.4		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	88.0		16.0		0.0		0.0		0.0	
Tipo de cambio promedio	3.6636		3.6600		0.0000		0.0000		0.0000	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0		0.3		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)									0.0	
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.3		0.0		0.0		0.0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,339.2**		**3,448.4**		**3,710.1**		**4,229.9**		**4,982.9**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).										
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%		0.0014%		0.0014%		0.0014%		0.0014%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,040.5		1,956.6		2,505.1		2,571.8		3,962.1	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,298.7**		**1,491.8**		**1,205.0**		**1,658.1**		**1,020.8**	
a. Encaje de exigible en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,825.5		8,770.1		8,733.6		8,671.0		8,658.9	
b. Encaje de exigible en moneda nacional promedio acumulado (% del TDSE) (*)	4.5		4.7		4.7		4.7		4.7	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,590.7		2,535.2		2,499.8		2,436.5		2,424.0	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TDSE) (*)	1.3		1.2		1.2		1.2		1.2	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		50.0		0.0		0.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	-- / -- / 0.25		-- / -- / 0.25		-- / -- / 0.25		-- / -- / 0.25		-- / -- / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0		80.0		40.0		0.0		30.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	-- / -- / --		0.25 / 0.25 / 0.025		0.25 / 0.25 / 0.25		-- / -- / --		0.25 / 0.25 / 0.25	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	64.0		0.0		0.0		59.6		0.0	
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$)	**19 Febrero 21**		**22 Febrero 21**		**23 Febrero 21**		**24 Febrero 21**		**25 Febrero 21**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	63.6		-44.5		-110.9		127.4		19.1	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-32.8		-6.8		-184.0		-203.7		-53.8	
a. Mercado spot con el público	192.9		18.4		-322.0		53.7		101.2	
i. (+) Compras	276.9		256.8		186.3		326.2		460.5	
ii. (-) Ventas	416.6		338.5		477.2		472.9		510.6	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	184.4		-15.5		-2.9		-100.6		29.6	
i. Pactadas	265.1		87.8		205.3		447.6		307.0	
ii. (-) Vencidas	80.7		103.3		208.2		548.2		277.4	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	208.8		3.7		-48.4		-430.1		28.7	
i. Pactadas	447.2		150.3		339.2		501.7		410.5	
ii. (-) Vencidas	237.4		146.6		387.5		931.8		381.8	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	353.5		169.8		711.9		651.7		483.5	
ii. A futuro	3.0		80.0		60.0		96.0		30.0	
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	158.4		136.6		175.7		350.2		301.2	
i. (+) Ventas	258.3		187.4		352.0		521.8		374.1	
ii. (-) Vencimientos	99.9		50.8		176.3		171.6		73.1	
f. Efecto de Opciones	-1.3		2.9		0.7		1.8		14.9	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	232.4		60.6		-31.5		-53.6		76.5	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6534		3.6545		3.6539		3.6509		3.6471	

(*) Datos preliminares