BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	26 Abr 21	27 Abr 21	28 Abr 21	29 Abr 21	30 Abr 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,018.7**	**21,529.6**	**23,694.0**	**23,485.4**	**22,413.0**
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					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	43,094.1	42,720.1	42,720.1	42,720.1	42,720.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de Mayo del 2021	374.0	1,020.0	1,020.0	1,020.0	1,020.0
Vencimiento de CD BCRP del 29. al 30 de Abr. de 2021	374.0	0.0	0.0	0.0	1,420.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,528.5	1,928.5	1,928.5	1,928.5	1,928.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de Junio del 2021	600.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo Valores del 29. al 30 de Abr. de 2021	600.0	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 30 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	1,680.2	1,680.2	1,681.1	1,681.1	1,679.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	8.3	8.3	8.3	8.3	0.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 29. al 30 de Abr. de 2021	8.3	8.3	8.3	8.3	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	S/ 900.0	S/ 900.0	S/ 900.0	S/ 900.0	S/ 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 29. 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 de CDV BCRP del 29. 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 29. al 30 de Abr. de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 614.7 15 212.3	1 718.0 16 747.5	2 388.0 17 379.5	2 000.2 18 015.9	1 517.0 15 668.9
Propuestas recibidas	1 614.7 15 212.3	1 718.0 16 747.5	2 388.0 17 379.5	2 496.0 18 015.9	1 517.0 15 668.9
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	0.24 0.24	0.24 0.24	0.24 0.23	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	9,682.5	26,262.6	26,151.8	26,730.7	24,906.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 3 de Mayo del 2021	3,500.1	19,878.3	19,437.2	19,009.8	17,283.6
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29. al 30 de Abr. de 2021	9,682.5	22,929.9	20,431.1	19,009.8	24,906.8
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 29. 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 29. al 30 de Abr. de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	40.0		Desierta	150.0 10.0	
Propuestas recibidas	40.0		-.-	150.0 10.0	
Plazo de vencimiento	95 d		93 d	92 d 92 d	
Tasas de interés: Mínima	0.25		-.-	0.23 0.25	
Máxima	0.25		-.-	0.23 0.25	
Promedio	0.25		-.-	0.23 0.25	
Saldo	6,535.0	6,525.0	6,425.0	6,585.0	6,585.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 3 de Mayo del 2021	50.0	100.0	520.0	520.0	520.0
Vencimiento de CDR BCRP del 29. al 30 de Abr. de 2021	150.0	100.0	0.0	0.0	930.0
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 29. al 30 de Abr. de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,622.0	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 29. 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 Reso					
Vencimiento de REPO del 29. 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	120.0				
Próximo vencimiento de Reso Expansion	120.0				
Vencimiento de REPO Expansión del 29. al 30 de Abr. de 2021	365 d				
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)	0.23				
Propuestas recibidas	0.23				
Plazo de vencimiento	0.23				
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 29. al 30 de Abr. de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	135.0 200.1 127.0 62.0 Desierta 120	Desierta 120.0 60.0 40.0 98.0 66.0 200.0 200.0		160.0	
Propuestas recibidas	135.0 230.1 127.0 62.0 -.- 120	-.- 120.0 60.0 40.0 98.0 66.0 260.0 215.0		160.0	
Plazo de vencimiento	92 d 365 d 365 d 95 d 365 d 365 d	365 d 365 d 365 d 94 d 94 d 94 d 365 d 365 d		365 d	
Tasas de interés: Mínima	0.20 0.23 0.24 0.23 -.- 0.23	0.00 0.23 0.24 0.25 0.20 0.23 0.23 0.24		0.24	
Máxima	0.25 0.25 0.24 0.25 -.- 0.25	0.00 0.25 0.25 0.25 0.25 0.25 0.25 0.25		0.25	
Promedio	0.25 0.25 0.24 0.25 -.- 0.25	0.00 0.25 0.24 0.25 0.25 0.25 0.25 0.25		0.24	
Saldo	S/ 877.6	S/ 585.6	S/ 585.6	S/ 585.6	S/ 585.6
Próximo vencimiento de SC Venta el 3 de Mayo del 2021	650.0	650.0	650.0	650.0	650.0
Vencimiento de SC - Venta del 29. al 30 de Abr. de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	950.0
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 29. 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	464.4	149.9	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	121.0	39.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	3.8382	3.8437	0.0000	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.2	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.2	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRLAG y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRLAG					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,687.3**	**2,914.2**	**3,926.0**	**3,469.4**	**5,227.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,751.3	1,860.8	3,106.6	2,024.0	2,973.0
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**936.0**	**1,053.4**	**819.4**	**1,445.4**	**2,254.0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,249.2	9,149.0	9,079.2	8,994.3	8,965.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.6	4.6	4.5	4.5	4.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,124.4	3,027.4	2,961.0	2,979.1	2,952.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.6	1.5	1.5	1.5	1.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	165.0	509.0	100.0	120.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.00 / 0.00 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	21.5	65.0	65.0	70.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.30 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	50.5	50.5	115.0	15.7	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$)	**Abr 23, 2021**	**Abr 26, 2021**	**Abr 27, 2021**	**Abr 28, 2021**	**Abr 29, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	104.9	-12.0	-5.7	-231.0	195.1
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-54.5	-60.6	-181.3	-389.4	-64.8
a. Mercado spot con el público	-176.0	-80.6	-168.5	-331.1	-66.6
i. Compras	227.1	408.8	320.7	420.7	439.6
ii. (-) Ventas	403.0	489.3	489.3	751.8	506.3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	145.8	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
i. Pactadas	219.7	144.5	236.8	411.4	365.9
ii. (-) Vencidas	203.9	142.5	206.6	287.5	136.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	43.3	11.9	22.1	-39.4	25.3
i. Pactadas	470.9	523.7	509.9	151.4	355.4
ii. (-) Vencidas	427.6	511.8	487.8	190.8	330.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias	264.6	297.9	289.6	401.9	292.2
i. Al contado	264.6	9.0	49.5	12.5	292.2
ii. A fecha	202.8	288.9	240.1	389.4	153.7
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	222.8	436.2	430.5	76.6	270.7
i. Compras	426.2	436.2	430.5	189.4	117.0
ii. (-) Ventas	203.4	138.1	199.9	266.0	153.6
f. Efecto de Opciones	2.4	0.4	-2.3	-4.9	13.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	306.9	81.5	197.9	-76.4	83.8
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7782	3.8358	3.8389	3.8036	3.7838

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera