BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	31 May 21	1 Jun 21	2 Jun 21	3 Jun 21	4 Jun 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**22,328.9**	**22,650.1**	**22,116.1**	**22,884.7**	**22,580.1**
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)	102.0	200.0 100.0	300.0	399.9	600.0
Propuestas recibidas	102.0	218.0 228.0	440.0	588.0	790.0
Plazo de vencimiento	28 d	94 d 27 d	26 d	35 d	34 d
Tasas de interés: Mínima	0.25	0.28 0.24	0.24	0.24	0.24
Máxima	0.25	0.28 0.24	0.24	0.24	0.24
Promedio	0.25	0.28 0.24	0.24	0.24	0.24
Saldo	42,595.5	42,895.5	43,195.5	42,925.4	43,525.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Junio del 2021	670.0	670.0	670.0	2,166.9	2,166.9
Vencimiento de CD BCRP del 07 al 11 de junio de 2021	670.0	670.0	670.0	0.0	2,166.9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,938.5	1,938.5	1,938.5	1,938.5	1,938.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de Junio del 2021	1.9	1.9	1.9	1.9	1.9
Vencimiento Repo Valores del 07 al 11 de junio 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 4 de Junio del 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,062.8	2,062.8	2,062.8	2,062.4	2,060.5
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	0.5	0.5	0.5	4.8	0.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 07 al 11 de junio de 2021	0.0	0.0	0.0	4.8	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 11 de junio 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 11 de junio 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 11 de junio de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,481.0 14,457.0	2,000.0 8,602.0	1,499.9 12,597.7	1,143.3 12,405.4	1,165.6 11,744.7
Propuestas recibidas	1,481.0 14,457.0	2,087.8 8,602.0	1,518.3 12,597.7	1,143.3 12,405.4	1,165.6 11,744.7
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	22,725.1	16,763.7	20,571.0	19,860.9	19,934.5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 7 de Junio del 2021	16,563.4	10,290.3	14,258.8	13,736.7	13,225.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 07 al 11 de junio de 2021	21,244.1	15,282.7	14,598.1	13,736.7	19,934.5
xi. Subasta de Colocación Temporal de Valores del Tesoro Público (CTP)	500.0				
Propuestas recibidas	497.5				
Plazo de vencimiento	97 d				
Tasas de interés: Mínima	0.30				
Máxima	0.86				
Promedio	0.35				
Saldo	3,320.5	3,320.5	3,320.5	3,820.5	3,820.5
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 07 al 11 de junio de 2021	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 07 al 11 de junio de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	60.0 200.0 100.0	Desierta 200.0 200.0 110.0		40.0	Desierta
Propuestas recibidas	60.0 244.0 100.0	-- 340.0 200.0 110.0		40.0	--
Plazo de vencimiento	92 d 60 d 60 d	62 d 62 d 62 d 62 d		61 d	61 d
Tasas de interés: Mínima	0.25 0.25 0.24	-- 0.24 0.25 0.25		0.25	--
Máxima	0.25 0.25 0.24	-- 0.25 0.25 0.25		0.25	--
Promedio	0.25 0.25 0.24	-- 0.24 0.25 0.25		0.25	--
Saldo	6,798.6	7,998.6	7,998.6	7,998.6	7,998.6
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Junio del 2021	900.0	900.0	900.0	910.0	910.0
Vencimiento de CDR BCRP del 07 al 11 de junio de 2021	900.0	900.0	900.0	0.0	498.0
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 11 de junio de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,922.0	1,922.0	1,922.0	1,922.0	1,922.0
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 07 al 11 de junio 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 Repo					
Vencimiento de REPO del 07 al 11 de junio 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 11 de junio 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 07 al 11 de junio de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	34,167.0	33,867.0	33,367.0	32,629.0	31,929.1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 7 de Junio del 2021	300.0	500.0	738.0	699.9	500.0
Vencimiento de SC - Venta del 07 al 11 de junio de 2021	2,237.9	1,937.9	1,437.9	699.9	1,931.1
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)		400.0 400.0	300.0 200.0	200.0 200.0	195.0
Propuestas recibidas		930.0 435.0	510.0 400.0	450.0 305.0	295.0
Plazo de vencimiento		14 d 14 d	14 d 90 d	14 d 14 d	14 d
Tasas de interés: Mínima		0.48 0.48	0.48 0.43	0.45 0.38	0.43
Máxima		0.50 0.60	0.58 0.45	0.45 0.38	0.45
Promedio		0.50 0.53	0.53 0.47	0.45 0.43	0.50
Saldo	962.0	1,722.0	2,222.0	2,622.0	2,735.0
Próximo vencimiento de RED el 7 de Junio del 2021	40.0	0.0	0.0	82.0	0.0
Vencimiento de RED del 07 al 11 de junio de 2021	122.0	82.0	82.0	282.0	200.0
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	0.0	571.3	233.0	356.7	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	148.0	60.0	93.0	0.0
Tipo de cambio promedio		3.8598	3.8835	3.8356	0.0000
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	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	56.1	151.7	230.1	0.0	145.2
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	56.1	151.7	230.1	0.0	145.2
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,972.8**	**10,515.2**	**6,755.3**	**8,136.4**	**8,729.6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Cotización Tasa efectiva diaria	0.00148%	0.00148%	0.00148%	0.00148%	0.00148%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	**4,947.7**	**2,486.4**	**2,560.4**	**2,251.6**	**3,137.0**
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**925.1**	**8,028.8**	**4,194.9**	**5,887.8**	**5,592.6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,456.4	8,407.5	14,017.3	**11,436.4**	11,976.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	4.3	4.3	7.1	**5.8**	6.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,394.3	2,346.0	8,028.8	**5,472.9**	5,999.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	1.2	1.2	4.1	**2.8**	3.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	35.0	176.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	40.0	29.0	24.8	52.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		0.30 / 0.50 / 0.32	0.30 / 0.50 / 0.41	0.30 / 0.30 / 0.30	0.35 / 0.50 / 0.47
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	50.6	203.6	206.5
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$)	**May 28, 2021**	**May 31, 2021**	**Jun 01, 2021**	**Jun 02, 2021**	**Jun 03, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-49.7	21.8	21.5	24.6	-92.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-262.3	-45.3	208.2	61.8	-17.8
a. Mercado spot con el público	-136.1	-69.6	-5.9	79.7	-71.9
i. Compras	457.0	377.5	490.0	628.9	557.8
ii. (-) Ventas	593.1	447.1	495.8	549.7	579.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	159.7	45.1	122.6	127.5	-52.6
i. Derivados	417.7	77.7	396.4	494.4	355.5
ii. (-) Ventas/Ias	252.5	32.6	328.0	366.8	353.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-36.6	-20.5	-62.0	14.2	-207.4
i. Derivados	143.9	107.6	336.0	514.4	307.6
ii. (-) Ventas/Ias	180.6	128.1	388.0	500.1	509.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	406.4	141.6	347.3	517.7	452.1
ii. A futuro	0.0	5.0	32.0	43.0	3.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-167.5	77.7	-8.8	-55.1	115.6
i. Compras	49.6	38.8	316.3	266.8	453.4
ii. (-) Ventas	247.5	9.6	325.1	298.0	348.8
f. Efecto de terceros	-3.7	1.5	44.1	-14.0	-28.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.3	92.7	200.8	-122.4	-144.3
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7945	3.8278	3.8474	3.8569	3.8547

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera