BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	21 Jun 21		22 Jun 21		23 Jun 21		24 Jun 21		25 Jun 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**24,138.3**		**22,782.6**		**21,975.8**		**21,706.8**		**21,583.3**	
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)	500.0		131.5		200.0	135.0	190.0		147.1	
Propuestas recibidas	591.5		131.5		320.0	145.0	300.0		157.1	
Plazo de vencimiento	95 d		94 d		93 d	34 d	92 d		91 d	
Tasas de interés: Mínima	0.24		0.28		0.27	0.24	0.27		0.26	
Máxima	0.28		0.28		0.27	0.25	0.28		0.28	
Promedio	0.28		0.28		0.27	0.25	0.28		0.26	
Saldo	43,241.7		43,373.2		43,116.3		43,306.3		43,306.3	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 28 de Junio del 2021	591.9		591.9		1,712.0		1,712.0		1,712.0	
Vencimiento de CD BCRP del 28 de junio al 2 de julio de 2021	591.9		591.9		0.0		0.0		1,712.0	
ii. Subasta de Correo Temporal de Valores (REPO)			200.0				200.0			
Propuestas recibidas			310.0				210.0			
Plazo de vencimiento			94 d				92 d			
Tasas de interés: Mínima			0.33				0.33			
Máxima			0.34				0.34			
Promedio			0.33				0.33			
Saldo	6,888.5		6,183.5		6,183.5		6,988.5		6,988.5	
Próximo vencimiento de Reos de Valores el 2 de Junio del 2021	1.5		1.5		1.5		1.5		1.5	
Vencimiento de Reos Valores del 28 de junio al 2 de julio 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 Reso de Cartera General										
Vencimiento de Reso de Cartera General el 25 de Junio del 2021										
iv. Subasta de Correo Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2,330.3		2,330.3		2,330.3		2,330.3		2,330.3	
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	0.5		0.5		0.5		0.5		0.5	
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 28 de junio al 2 de julio de 2021	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
v. Subasta de Correo 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 Correo 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 Reos Especial - CDR del 28 de junio al 2 de julio 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 28 de junio al 2 de julio 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 28 de junio al 2 de julio de 2021										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000.2	16 014.0	2 000.0	15 325.8	1 524.2	14 775.7	1 331.0	15 090.5	1 227.0	14 745.1
Propuestas recibidas	2 515.3	16 129.0	2 664.5	15 325.8	1 524.2	14 775.7	1 331.0	15 090.5	1 227.0	14 745.1
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	8 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	0.25	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	23,991.7		23,803.4		23,504.0		23,745.8		6,855.4	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 28 de Junio del 2021	17,514.1		16,599.3		16,179.7		16,890.4		2,000.2	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 28 de junio al 2 de julio de 2021	21,991.5		19,803.2		17,076.6		16,890.4		6,855.4	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (CTP DCTP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	4,939.5		4,939.5		4,939.5		4,939.5		4,939.5	
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 28 de junio al 2 de julio 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 28 de junio al 2 de julio de 2021										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	Desierta		Desierta		20.0					
Propuestas recibidas	- -		- -		20.0					
Plazo de vencimiento	60 d		62 d		61 d					
Tasas de interés: Mínima	- -		- -		0.44					
Máxima	- -		- -		0.44					
Promedio	- -		- -		0.44					
Saldo	7,054.0		7,054.0		7,054.0		7,054.0		7,054.0	
Próximo vencimiento de CTD BCRP el 28 de Junio del 2021	190.0		190.0		190.0		190.0		190.0	
Vencimiento de CTD BCRP del 28 de junio al 2 de julio de 2021	0.0		0.0		0.0		0.0		190.0	
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 28 de junio al 2 de julio 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 Reso Regular el 10 de Agosto del 2021	50.0		50.0		50.0		50.0		50.0	
Vencimiento de REPO del 28 de junio al 2 de julio 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 28 de junio al 2 de julio 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 Reso Expansión										
Vencimiento de REPO Expansión del 28 de junio al 2 de julio 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 Reso Sustitución										
Vencimiento de REPO Sustitución del 28 de junio al 2 de julio de 2021										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					20.0		Desierta	Desierta	Desierta	
Propuestas recibidas					20.0		- -	- -	20.0	
Plazo de vencimiento					183 d	182 d	183 d	182 d	186 d	
Tasas de interés: Mínima					0.45		- -	- -	- -	
Máxima					0.45		- -	- -	- -	
Promedio					0.45		- -	- -	- -	
Saldo	29,798.0		28,998.0		28,618.0		28,500.0		28,000.0	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 28 de Junio del 2021	800.0		400.0		118.0		500.0		483.0	
Vencimiento de SC - Venta del 28 de junio al 2 de julio de 2021	1,818.0		1,018.0		618.0		500.0		1,142.0	
xx. Subasta de Reso de Valores para ofrecer dólares (REDI)			137.0						200.0	
Propuestas recibidas			137.0						200.0	
Plazo de vencimiento			14 d						14 d	
Tasas de interés: Mínima			0.40						0.40	
Máxima			0.40						0.40	
Promedio			0.40						0.40	
Saldo	2,525.0		2,662.0		1,917.0		1,757.0		1,182.0	
Próximo vencimiento de RED el 28 de Junio del 2021	0.0		745.0		160.0		575.0		90.0	
Vencimiento de RED del 28 de junio al 2 de julio de 2021	1,480.0		1,480.0		735.0		1,620.0		1,045.0	
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	95.0		596.6		406.0		597.6		398.7	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	24.0		150.0		102.0		150.0		100.0	
Tipo de cambio promedio	3.9567		3.9770		3.9800		3.9843		3.9870	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	400.1		36.5		-50.0		0.3		0.0	
i. Compras (millones de US$)	400.1		36.5		0.0		0.3		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)					50.0					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,529.1**		**5,063.8**		**4,995.2**		**4,732.7**		**5,065.4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)										
(Operación libre efectiva diaria)	0.000%.		0.000%.		0.000%.		0.000%.		0.000%.	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	**4,783.0**		**4,256.0**		**4,332.0**		**4,208.0**		**4,395.3**	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**746.1**		**747.8**		**623.2**		**524.7**		**670.1**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,002.8		8,874.2		8,779.8		8,683.7		8,596.5	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	4.5		4.5		4.4		4.4		4.3	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,033.2		2,899.6		2,806.1		2,710.0		2,618.6	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	1.5		1.5		1.4		1.4		1.3	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		0.0		25.0		150.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	129.5		111.5		155.0		0.0		217.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.50 / 0.60 / 0.52		0.50 / 0.60 / 0.53		0.50 / 0.60 / 0.52				0.40 / 0.45 / 0.45	
c. Total mercado secundario de COBCRP, CDBCRP-NR v CDV	6.0		65.5		58.2		40.0		40.0	
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$)	**Jun 18, 2021**		**Jun 21, 2021**		**Jun 22, 2021**		**Jun 23, 2021**		**Jun 24, 2021**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-2.8		-13.0		-65.9		-3.3		26.6	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	150.4		35.0		130.5		14.6		92.5	
a. Mercado spot con el público	390.1		49.5		1.8		-28.5		-15.0	
i. Compras	513.0		293.2		352.3		294.5		520.8	
ii. (-) Ventas	306.8		246.3		350.6		323.3		535.8	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	46.5		-124.9		-233.3		-20.8		-100.5	
i. Derivados	348.5		87.6		116.5		496.0		580.6	
ii. (-) Vencidas	203.8		212.6		349.9		475.8		681.1	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	188.2		-77.1		-256.7		-108.0		-87.9	
i. Derivados	344.1		187.1		89.4		253.7		230.3	
ii. (-) Vencidas	145.9		264.2		346.2		362.2		318.0	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	187.1		86.9		233.3		229.6		361.3	
ii. A futuro	31.0		16.0		83.0		27.0		67.0	
e. Operaciones sod asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entregas	407.0		227.5		216.6		199.8		269.8	
i. (-) Compras	88.0		216.7		308.0		300.3		261.6	
ii. (-) Ventas	185.1		194.3		331.6		499.9		672.4	
f. Efecto Swap cambiario	0.5		-0.2		-0.2		-1.8		-21.2	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-16.6		17.4		-71.1		-4.6		123.1	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9433		3.9601		3.9747		3.9787		3.9849	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera