BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	02 Ago 21	03 Ago 21	04 Ago 21	05 Ago 21	06 Ago 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**23,233.9**	**23,262.5**	**22,741.9**	**22,936.2**	**23,126.5**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias asociadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)	55.6 500.0	99.9	100.0 186.0	300.0	272.0
Posturas recibidas	102.6 543.0	116.0	168.0 196.0	333.0	272.0
Plazo de vencimiento	92 d 31 d	30 d	90 d 29 d	28 d	27 d
Tasas de interés: Mínima	0.28 0.24	0.24	0.28 0.24	0.24	0.24
Máxima	0.28 0.25	0.25	0.28 0.25	0.25	0.25
Promedio	0.28 0.25	0.25	0.28 0.25	0.25	0.25
Saldo	40,248.0	38,457.9	38,893.9	37,778.9	38,090.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 12 de Agosto del 2021	1,940.0	1,565.0	1,565.0	1,700.2	1,700.2
Vencimiento de CD BCRP del 09 al 13 de ago de 2021	3,505.0	1,565.0	1,565.0	0.0	1,700.2
ii. Subasta de Correa Temporal de Valores (REPO)					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9,633.8	9,633.8	9,433.8	9,433.8	9,433.8
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 3 de Setiembre del 2021	60.0	200.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de Reso Valores del 09 al 13 de ago de 2021	0.0	200.0	0.0	0.0	0.0
iii. Subasta de Correa Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Posturas 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 09 al 13 de ago de 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,838.1	2,838.1	2,838.1	2,838.1	2,838.1
Próximo vencimiento de Reso 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 09 al 13 de ago de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Correa Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)					
Garantía oara los créditos					
Posturas 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 Correa Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)					
Garantía oara los créditos					
Posturas 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)					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reso Especial - CDR del 09 al 13 de ago de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 09 al 13 de ago de 2021					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 09 al 13 de ago de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000.1 12 259.9	1 397.5 14 465.9	1 000.1 14 211.4	1 500.0 14 395.7	2 500.0 13 800.3
Posturas recibidas	2 085.0 12 259.9	1 397.5 14 465.9	1 555.0 14 211.4	1 506.0 14 395.7	2 850.0 14 673.9
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	0.25 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	17,080.1	19,683.5	20,429.1	22,113.4	22,198.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 9 de Agosto del 2021	13,260.0	14,465.9	14,211.4	16,215.7	15,800.4
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 09 al 13 de ago de 2021	15,080.0	16,285.9	16,031.4	16,215.7	22,198.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Posturas 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	976.0	976.0	976.0	976.0	976.0
Vencimiento de Coloc-TP del 09 al 13 de ago 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					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 09 al 13 de ago de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reasustables del BCRP (CDR BCRP)	190.0 200.0	1.1	120.0 150.0		
Posturas recibidas	190.0 250.0		120.0 150.0		
Plazo de vencimiento	60 d 60 d		61 d 61 d		
Tasas de interés: Mínima	0.24 0.24		0.25 0.60		
Máxima	0.24 0.25		0.60 0.60		
Promedio	0.24 0.24		0.54 0.60		
Saldo	6,970.0	6,930.0	6,890.0	6,890.0	6,620.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de Asosto del 2021	40.0	310.0	270.0	270.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 09 al 13 de ago de 2021	620.0	580.0	270.0	270.0	794.0
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restrinsida (CDBCRP-NR)					
Posturas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 09 al 13 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	1,922.0	1,922.0	1,922.0	1,922.0	1,922.0
Próximo vencimiento de Reso Reoular el 10 de Asosto del 2021	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de REPO del 09 al 13 de ago de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	50.0
xvi. Venta de Moneda Extranera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 09 al 13 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 09 al 13 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 Reso Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 09 al 13 de ago de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	40.0				
Posturas recibidas	75.0				
Plazo de vencimiento	60 d				
Tasas de interés: Mínima	0.59				
Máxima	0.60				
Promedio	0.59				
Saldo	24,365.9	24,365.9	24,365.9	24,365.9	24,325.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 de Asosto del 2021	40.0	40.0	40.0	40.0	580.1
Vencimiento de SC - Venta del 09 al 13 de ago de 2021	40.0	40.0	40.0	40.0	0.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)	200.0 195.0	200.0 200.0	200.0	105.0	
Posturas recibidas	427.0 195.0	345.0 285.0	228.0	105.0	
Plazo de vencimiento	14 d 14 d	14 d 14 d	14 d	14 d	
Tasas de interés: Mínima	0.38 0.34	0.36 0.35	0.34	0.31	
Máxima	0.41 0.39	0.42 0.39	0.38	0.35	
Promedio	0.40 0.36	0.42 0.37	0.36	0.33	
Saldo	1,770.1	1,970.1	2,170.1	2,275.1	2,275.1
Próximo vencimiento de RED el 9 de Asosto del 2021	200.0	145.0	145.0	145.0	145.0
Vencimiento de RED del 09 al 13 de ago de 2021	200.0	0.0	0.0	0.0	905.1
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	122.6	122.4	0.0	867.8
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)		30.0	30.0		212.0
Tipo de cambio promedio		4.0850	4.0810		4.0935
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	-94.0	0.0	0.0	-0.4
i. Compras (millones de US$)					
ii. Ventas (millones de US$)		94.0	0.0	0.0	0.4
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP v CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7,868.3**	**7,126.6**	**6,502.2**	**6,590.5**	**5,646.4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0013%	0.0013%	0.0013%	0.0013%	0.0013%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2 519.3	1 853.3	1 981.4	1 884.3	1 854.5
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5,348.0**	**5,273.3**	**4,520.6**	**4,706.2**	**3,791.9**
a. Encaje en exceso en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	8,470.6	10,382.7	10,698.5	10,451.9	10,544.1
b. Encaje en exceso en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.1	5.1	5.3	5.1	5.2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,347.8	4,274.4	4,505.2	4,357.8	4,446.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.1	2.1	2.2	2.1	2.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	0.0	60.0
Tasas de interés Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	58.5	48.0	66.7	68.0	68.0
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 / 0.50 / 0.27	0.25 / 0.50 / 0.27
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	26.8	40.0	51.9
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$)	**Jul 30, 2021**	**Ago 02, 2021**	**Ago 03, 2021**	**Ago 04, 2021**	**Ago 05, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	91.1	-17.5	18.9	12.7	-64.3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	22.6	41.8	-69.6	97.3	22.1
a. Mercado spot con el público	-194.9	162.2	-4.0	87.8	45.2
i. Compras	416.4	454.4	339.6	307.6	442.4
ii. (-) Ventas	611.3	292.2	343.6	219.7	397.2
b. Compras forward y swap al público (con v sin entrega)	101.7	57.9	73.5	-120.3	-241.9
i. Pactadas	278.0	242.2	138.1	182.0	268.3
ii. (-) Vencidas	176.3	184.3	64.6	302.3	510.2
c. Ventas forward y swap al público (con v sin entrega)	79.4	127.4	-14.9	-34.3	-165.8
i. Pactadas	272.6	289.0	188.3	298.9	262.8
ii. (-) Vencidas	193.2	161.6	183.1	243.2	448.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	317.3	390.7	345.6	297.0	370.4
ii. A futuro	46.0	10.0	50.0	69.0	139.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	-35.9	-52.0	47.7	-62.8	-82.3
i. Compras	132.7	122.7	111.1	236.7	423.4
ii. (-) Ventas	168.6	174.8	63.4	299.5	505.8
f. Efecto de Opciones	0.2	0.3	0.1	1.3	-10.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	316.3	-81.2	5.3	13.3	-2.5
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0582	4.0544	4.0800	4.0776	4.0671
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera