BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	15 Mar 21	16 Mar 21	17 Mar 21	18 Mar 21	19 Mar 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**26,380.3**	**24,957.1**	**23,096.5**	**23,225.1**	**24,046.1**
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)	200.0 500.0 500.0	499.9 200.0 194.5	500.1	500.0	500.0 500.0
Prosuestas recibidas	410.0 576.0 604.0	803.0 268.0 194.5	662.0	873.0	799.0 1296.3
Plazo de vencimiento	189 d 98 d 31 d	188 d 97 d 31 d	187 d	186 d	185 d 94 d
Tasas de interés: Mínima	0.31 0.27 .25	0.31 0.28 0.25	0.30	0.31	0.30 0.27
Máxima	0.31 0.28 .25	0.31 0.28 0.25	0.31	0.31	0.31 0.28
Promedio	0.31 0.28 .25	0.31 0.28 0.25	0.31	0.31	0.31 0.28
Saldo	44,420.3	45,499.7	45,999.8	46,499.8	45,445.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 19 de Marzo del 2021	1,045.0	2,054.1	2,054.1	2,054.1	2,100.0
Vencimiento de CD BCRP del 19 al 26 de Mar. de 2021	3,099.1	2,054.1	2,054.1	2,054.1	2,959.2
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6,176.5	5,903.5	5,903.5	5,903.5	5,903.5
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 22 de Marzo del 2021	375.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Reso Valores del 19 al 26 de Mar. de 2021	375.0	0.0	0.0	0.0	900.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso de Cartera General					
Vencimiento de Reso de Cartera General el 18 de Marzo del 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,269.1	1,269.1	1,269.1	1,268.0	1,263.4
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 19 de Marzo del 2021	3.6	3.6	3.6	19.6	0.7
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 19 al 26 de Mar. de 2021	23.2	23.2	23.2	19.6	0.7
v. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)					
Garantía para los créditos					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo adjudicado	53,999.9	53,999.9	53,999.9	53,999.9	53,999.9
vi. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Especial)					
Garantía para los créditos					
Prosuestas 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)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR					
Vencimiento de Reso Especial - CDR del 19 al 26 de Mar. de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDV BCRP					
Vencimientos de CDV BCRP del 19 al 26 de Mar. de 2021					
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDLD BCRP					
Vencimiento de CDLD BCRP del 19 al 26 de Mar. de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	4 000.0 16 700.2	4 499.9 16 299.8	2 773.0 16 299.8	3 499.9 16 309.0	4 000.1 16 499.9
Prosuestas recibidas	4 640.0 17 640.6	4 940.0 16 536.1	2 773.0 16 557.9	3 652.7 16 309.0	4 504.9 16 818.5
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 0.23	0.24 0.23	0.24 0.23	0.24 0.23
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	38,373.5	37,299.8	36,072.7	35,081.9	35,272.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de Marzo del 2021	22,290.8	20,299.9	20,799.7	20,309.1	20,499.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 19 al 26 de Mar. de 2021	55,073.7	28,799.9	24,799.8	20,309.1	35,272.8
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Prosuestas 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 19 al 26 de Mar. de 2021					
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 19 al 26 de Mar. de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	80.0			150.0	150.0
Prosuestas recibidas	80.0			150.0	150.0
Plazo de vencimiento	92 d			92 d	92 d
Tasas de interés: Mínima	0.25			0.25	0.25
Máxima	0.25			0.25	0.25
Promedio	0.25			0.25	0.25
Saldo	8,224.0	8,219.0	8,159.0	8,309.0	8,309.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 22 de Marzo del 2021	85.0	60.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 19 al 26 de Mar. de 2021	145.0	60.0	0.0	200.0	400.0
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Mantenimiento Desconocido (CDBCRP-NR)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR					
Vencimientos de CD BCRP del 19 al 26 de Mar. de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,830.0	4,830.0	4,430.0	4,130.0	3,730.0
Próximo vencimiento de Reso Regular el 19 de Marzo del 2021	400.0	400.0	300.0	400.0	400.0
Vencimiento de REPO del 19 al 26 de Mar. de 2021	1,100.0	1,100.0	700.0	400.0	700.0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 19 al 26 de Mar. de 2021					
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Especial)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso Extensión					
Vencimiento de REPO Extensión del 19 al 26 de Mar. de 2021					
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reso Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 19 al 26 de Mar. de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	Desierta	200.0 400.1	37.0	500.0 110.0	100.0
Prosuestas recibidas	- -	260.0 437.0	37.0	517.0 120.0	100.0
Plazo de vencimiento	275 d	92 d 275 d	275 d	274 d 274 d	276 d
Tasas de interés: Mínima	- -	0.25 0.24	0.24	0.23 0.25	0.25
Máxima	- -	0.24 0.24	0.24	0.24 0.24	0.24
Promedio	- -	0.24 0.24	0.24	0.24 0.24	0.24
Saldo	20,954.5	21,304.6	21,196.6	21,616.6	21,816.6
Próximo vencimiento de SC-Venta el 26 de Abril del 2021	50.0	35.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de SC - Venta del 19 al 26 de Mar. de 2021	85.0	35.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Prosuestas recibidas					
Plazo de vencimient Mínima					
Tasas de interés: Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de SC-Compra					
Vencimiento de SC - Compra del 19 al 26 de Mar. de 2021					
b. Liquidación de Reportos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circ	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	137.1	140.7	148.1	148.3	254.4
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	37.0	38.0	40.0	40.0	69.0
Tipo de cambio promedio	3.7055	3.7016	3.7030	3.7069	3.7159
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	150.0	500.3	300.0	300.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	150.0	500.3	300.0	300.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,776.2**	**3,122.3**	**3,371.2**	**2,617.9**	**2,289.7**
4. Operaciones monetarias del BCR sana el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por reculación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	1,813.4	1,642.5	2,019.6	1,336.7	1,285.5
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
Tasa de interés	**1,962.8**	**1,479.8**	**1,351.6**	**1,336.2**	**1,004.2**
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones					
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,401.3	9,309.3	9,191.4	9,101.0	9,020.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.6	4.5	4.5	4.4	4.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,059.7	2,964.9	2,849.2	2,758.9	2,680.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.5	1.4	1.4	1.3	1.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25	-.- / -.- / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	270.0	123.5	92.0	100.0	105.0
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 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de COBCRP, CDBCRP-NR y CDV	46.0	46.0	50.0	84.0	398.0
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$)	**12 Marzo 21**	**15 Marzo 21**	**16 Marzo 21**	**17 Marzo 21**	**18 Marzo 21**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	38.4	0.4	-72.5	29.3	-19.8
Flujo de la posición cambiaria = a + b.i - c.i + e + g	38.4	0.4	-72.5	29.3	-19.8
a. Mercado spot con el público	58.3	27.4	-208.9	-14.9	177.0
i. Compras	292.4	315.4	246.2	266.2	226.4
ii. (-) Ventas	274.1	274.0	474.3	283.1	338.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	14.1	-44.5	-47.2	28.6	-42.1
i. Pactadas	202.4	253.4	160.8	259.6	171.0
ii. (-) Vencidas	188.3	297.9	208.0	231.0	213.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	75.8	-8.7	-4.9	-27.0	109.5
i. Pactadas	325.2	355.5	153.1	404.2	373.4
ii. (-) Vencidas	249.4	364.2	158.0	431.2	263.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	387.1	536.6	693.3	385.9	387.9
ii. A futuro	70.0	76.0	15.0	7.0	75.0
e. Operaciones post asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	73.0	53.8	-66.2	180.1	62.3
i. Compras	242.9	343.7	140.9	380.1	262.6
ii. (-) Ventas	170.0	289.9	207.1	200.0	200.3
f. Efecto de Opciones	-0.1	17.6	17.5	-13.7	17.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	70.1	-5.4	196.5	24.3	250.3
h. Crédito por reculación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7056	3.7152	3.7040	3.7	3.7053

(*) Data preliminar

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera