BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	29 Mar 21	30 Mar 21	31 Mar 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**22,101.1**	**26,278.0**	**23,412.4**
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)	325.0	500.0	200.0
Propuestas recibidas	365.0	576.1	255.0
Plazo de vencimiento	182 d	90 d	180 d
Tasas de interés: Mínima	0.31	0.27	0.31
Máxima	0.31	0.28	0.31
Promedio	0.31	0.28	0.31
Saldo	46.121.4	44.301.2	44.501.2
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Abril del 2021	2.320.2	1.860.0	1.860.0
Vencimiento de CD BCRP del 5. al 9 de Abr. de 2021	2.320.2	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	4.903.5	4.453.5	4.453.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 14 de Abril del 2021	450.0	200.0	200.0
Vencimiento de Repo Valores del 5. al 9 de Abr. de 2021	450.0	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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General			
Vencimiento de Repo de Cartera General el 30 de Marzo del 2021			
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de interés: Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	1.458.3	1.458.3	1.491.1
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 9 de Abril del 2021	34.5	34.5	34.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 5. al 9 de Abr. de 2021	0.0	0.0	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
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
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 5. al 9 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 5. al 9 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 5. al 9 de Abr. de 2021			
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1.999.9 / 16.797.1	4.512.5 / 17.435.3	3.500.2 / 12.981.0
Propuestas recibidas	2.163.0 / 16.797.1	4.512.5 / 17.435.3	3.793.0 / 12.981.0
Plazo de vencimiento	7 d / 1 d	7 d / 1 d	7 d / 5 d
Tasas de interés: Mínima	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
Promedio	0.25 / 0.25	0.25 / 0.25	0.25 / 0.25
Saldo	32.135.2	32.785.7	28.331.5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Marzo del 2021	21.297.3	20.935.4	20.318.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5. al 9 de Abr. de 2021	24.797.4	20.935.4	0.0
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
Próximo vencimiento de Coloc-TP			
Vencimiento de Coloc-TP del 5. al 9 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 5. al 9 de Abr. de 2021			
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	120.0		
Propuestas recibidas	120.0		
Plazo de vencimiento	91 d		
Tasas de interés: Mínima	0.25		
Máxima	0.25		
Promedio	0.25		
Saldo	7.299.0	6.959.0	6.869.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 31 de Marzo del 2021	340.0	90.0	636.0
Vencimiento de CDR BCRP del 5. al 9 de Abr. de 2021	430.0	90.0	0.0
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 5. al 9 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	2.730.0	2.730.0	2.430.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 31 de Marzo del 2021	300.0	300.0	600.0
Vencimiento de REPO del 5. al 9 de Abr. de 2021	300.0	300.0	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 5. al 9 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			
Próximo vencimiento de Repo Expansion			
Vencimiento de REPO Expansión del 5. al 9 de Abr. 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 Sustitucion			
Vencimiento de REPO Sustitución del 5. al 9 de Abr. de 2021			
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	144.0 / 400.0 / 60.0 / 40.0 / Desierta / 455.0	60.0 / 186.0 / 150.0 / 354.0 / 150.0 / 139.0 / 500.0	150.0 / 200.0
Propuestas recibidas	144.0 / 405.0 / 60.0 / 40.0 / --- / 455.0	60.0 / 186.0 / 150.0 / 354.0 / 150.0 / 139.0 / 559.0	165.0 / 201.0
Plazo de vencimiento	91 d / 365 d / 91 d / 365 d / 91 d / 365 d	92 d / 365 d / 92 d / 365 d / 92 d / 92 d / 365 d	91 d / 365 d
Tasas de interés: Mínima	0.24 / 0.22 / 0.25 / 0.25 / -.- / 0.21	0.25 / 0.22 / 0.25 / 0.23 / 0.25 / 0.25 / 0.23	0.25 / 0.23
Máxima	0.25 / 0.22 / 0.25 / 0.25 / -.- / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25 / 0.25 / 0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25
Promedio	0.24 / 0.25 / 0.25 / 0.25 / -.- / 0.24	0.25 / 0.24 / 0.25 / 0.25 / 0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.24
Saldo	26.713.7	28.252.7	28.617.7
Próximo vencimiento de SC-Venta el 26 de Abril del 2021	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de SC - Venta del 5. al 9 de Abr. de 2021	0.0	0.0	0.0
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 5. al 9 de Abr. de 2021			
b. Liquidación de Repos de Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circu	0.0	0.0	0.0
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	416.1	416.1	367.2
i. Compras (millones de US$)			
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US$)	111.0	127.0	98.0
Tipo de cambio promedio	3.7487	3.7691	3.7473
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	300.0	300.0	3.8
i. Compras (millones de US$)	300.0	300.0	3.8
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3.351.5**	**3.351.5**	**6.364.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0014%	0.0014%	0.0014%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés			
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2.137.3	2.272.3	2.185.6
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,214.2**	**846.0**	**4,178.4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8.478.3	8.452.6	8.478.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.1	4.1	4.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2.140.3	2.113.4	2.140.3
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.0	1.0	1.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	45.0	50.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	90.0	60.0	38.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	45.0	234.6	11.2
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$)	**26 Marzo 21**	**29 Marzo 21**	**30 Marzo 21**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	24.1	-38.5	15.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	98.7	-167.0	6.8
a. Mercado spot con el público	43.5	-119.2	-18.0
i. Compras	417.4	322.8	408.1
ii. (-) Ventas	373.9	442.1	426.1
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-32.8	-134.1	-351.7
i. Pactadas	129.4	255.5	332.6
ii. (-) Vencidas	162.2	389.6	684.3
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	82.0	31.8	35.6
i. Pactadas	211.2	560.9	1023.0
ii. (-) Vencidas	129.2	529.1	987.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias			
i. Al contado	440.8	384.2	596.4
ii. A futuro	20.0	85.0	5.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-19.2	149.7	295.7
i. Compras	128.0	527.1	943.5
ii. (-) Ventas	147.2	377.3	647.8
f. Efecto de Opciones	-1.3	1.2	-12.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	82.9	235.2	440.9
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés			
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7366	3.7489	3.7656
(*) Datos preliminares			

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera