BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	24 May 21		25 May 21		26 May 21		27 May 21		28 May 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**22,749.6**		**22,111.9**		**21,527.0**		**5,684.0**		**20,608.9**	
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones										
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR										
Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)	93.0		152.0	99.9	22.0	200.0	178.0		231.0	
Propuestas recibidas	123.0		187.0	143.0	172.0	250.0	178.0		231.0	
Plazo de vencimiento	175 d		174 d	29 d	173 d	28 d	81 d		80 d	
Tasas de interés: Mínima	0.31		0.31	0.24	0.31	0.25	0.26		0.26	
Máxima	0.31		0.31	0.25	0.31	0.25	0.28		0.28	
Promedio	0.31		0.31	0.25	0.31	0.25	0.27		0.27	
Saldo	41,610.6		41,862.5		42,084.5		42,262.5		42,493.5	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 3 de Junio del 2021	670.0		670.0		670.0		670.0		670.0	
Vencimiento de CD BCRP del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	0.0		0.0		0.0		0.0		670.0	
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 2 de Agosto del 2021	1.9		1.9		1.9		1.9		1.9	
Vencimiento de Reso Valores del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	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 28 de Mayo del 2021										
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2,064.6		2,064.6		2,064.6		2,064.6		2,062.8	
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	6.0		6.0		6.0		6.0		0.5	
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	6.0		6.0		6.0		6.0		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		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 Reso Especial - CDR del 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
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 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
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 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2,833.0	13,533.6	2,106.4	14,618.5	1,688.3	14,384.5	1,661.1	14,423.7	1,331.3	12,767.8
Propuestas recibidas	2,833.0	13,533.6	2,106.4	14,618.5	1,688.3	14,384.5	1,661.1	14,423.7	1,331.3	12,767.8
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	-0.25	0.24	0.24	0.24	0.24	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	0.24	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25	0.25
Saldo	26,242.7		26,434.3		25,329.6		24,315.7		22,387.9	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Mayo del 2021	16,533.3		17,177.5		17,068.7		16,026.9		15,600.8	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	25,409.7		21,494.9		18,701.9		16,034.9		22,387.9	
xi. Subasta de Colocación TP en M.N. del Tesoro Público (CD TP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2,820.5		2,820.5		2,820.5		2,820.5		2,820.5	
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 31 de mayo al 04 de junio de 2019	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 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	25.0	130.0	Desierta	Desierta	100.0		100.0			
Propuestas recibidas	25.0	130.0	-.-	-.-	100.0		100.0			
Plazo de vencimiento	60 d	92 d	92 d	92 d	92 d		92 d			
Tasas de interés: Mínima	0.25	0.25	-.-	-.-	0.24		0.25			
Máxima	0.25	0.25	-.-	-.-	0.24		0.25			
Promedio	0.25	0.25	-.-	-.-	0.24		0.25			
Saldo	6,499.0		6,599.0		6,599.0		6,599.0		6,599.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 5 de Junio del 2021	930.0		900.0		900.0		900.0		900.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	930.0		0.0		0.0		0.0		900.0	
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 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	1,767.0		1,852.0		1,852.0		1,852.0		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 31 de mayo al 04 de junio de 2019	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 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
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 Estansion										
Vencimiento de REPO Expansión del 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
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 31 de mayo al 04 de junio de 2019										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	10.0		200.0	500.0	300.0					
Propuestas recibidas	10.0		384.0	925.0	600.0					
Plazo de vencimiento	365 d		91 d	91 d	91 d					
Tasas de interés: Mínima	0.25		0.25	0.55	0.40					
Máxima	0.25		0.55	0.55	0.40					
Promedio	0.25		0.40	0.47	0.40					
Saldo	34,167.0		34,167.0		34,167.0		34,167.0		34,167.0	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Junio del 2021	300.0		300.0		300.0		300.0		300.0	
Vencimiento de SC - Venta del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	0.0		0.0		0.0		0.0		2,237.9	
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (REDI)	200.0		140.0				200.0		200.0	
Propuestas recibidas	240.0		190.0				335.0		250.0	
Plazo de vencimiento	91 d		91 d				35 d		14 d	
Tasas de interés: Mínima	0.93		0.93				0.96		0.97	
Máxima	0.96		0.96				0.97		0.97	
Promedio	0.96		0.94				0.96		0.97	
Saldo	1,351.9		1,101.9		693.0		782.0		962.0	
Próximo vencimiento de RED el 1 de Junio del 2021	390.0		508.9		111.0		20.0		40.0	
Vencimiento de RED del 31 de mayo al 04 de junio de 2019	1,029.9		639.9		131.0		142.0		122.0	
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	570.6		614.7		631.6		890.6		0.0	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	150.0		160.0		164.0		230.0		0.0	
Tipo de cambio promedio	3.8043		3.8416		3.8515		3.8721			
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0		0.7		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.7		0.0		0.0		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)										
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		132.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR									0.0	
ii. Compras de BTP (Valorizado)									132.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,564.4**		**4,426.4**		**4,500.6**		**4,793.4**		**6,146.8**	
4. Operaciones monetarias del BCR con el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)										
(Posición fines efectivo diario)	0.00[illegible]		0.00[illegible]		0.00[illegible]		0.00[illegible]		0.00[illegible]	
b. Compra temporal directa de valores (Tasa de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	4,597.1		3,648.5		3,640.0		3,643.2		5,144.5	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**967.3**		**771.9**		**860.6**		**1,150.2**		**1,002.3**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,931.0		8,931.0		8,722.0		8,658.3		8,615.5	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.5		4.5		4.4		4.4		4.4	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,854.8		2,854.8		2,652.9		2,589.8		2,548.7	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.4		1.4		1.3		1.3		1.3	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		200.0		0.0		70.0		0.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	100.0		141.0		168.5		163.5		90.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.30 / 0.30 / 0.30		0.30 / 0.30 / 0.30		0.30 / 0.30 / 0.30		0.30 / 0.30 / 0.30		0.30 / 0.30 / 0.30	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	40.5		6.0		3.5		70.0		0.0	
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$)	**May 21, 2021**		**May 24, 2021**		**May 25, 2021**		**May 26, 2021**		**May 27, 2021**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-28.7		-3.9		27.6		-72.9		-142.4	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-97.8		138.1		71.4		-15.9		-94.5	
a. Mercado spot con el público	-[illegible]		-[illegible]		-[illegible]		-[illegible]		-[illegible]	
i. Compras	342.5		392.6		417.6		372.7		524.8	
ii. (-) Ventas	446.3		416.0		448.0		570.8		808.9	
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	181.3		-193.8		0.4		-111.8		38.8	
i. Derechos	568.7		757.7		914.8		595.5		795.5	
ii. (-) Vencidas	186.9		426.0		315.4		707.2		356.5	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	121.5		-49.7		72.1		-42.1		88.4	
i. Derechos	453.5		177.7		287.7		248.4		345.0	
ii. (-) Vencidas	331.8		226.8		215.2		291.5		156.6	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	449.4		490.7		365.5		558.1		696.1	
ii. A futuro	23.0		134.0		20.0		40.0		23.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	85.5		-255.5		-194.4		-458.5		-251.4	
i. (-) Compras	234.5		188.1		188.2		286.9		104.2	
ii. (-) Ventas	151.2		408.3		298.6		697.4		335.6	
f. Efecto de operaciones	9.3		-0.5		27.6		12.8		-0.1	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	67.6		185.2		111.9		197.0		221.1	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7454		3.7999		3.8373		3.8444		3.8644	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera