BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	7 Jun 21	8 Jun 21	9 Jun 21	10 Jun 21	11 Jun 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**24,273.8**	**22,710.6**	**22,475.7**	**22,482.5**	**21,325.8**
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)	590.0 999.9	760.0	128.0	95.0	500.0
Propuestas recibidas	606.0 1416.5	760.0	134.0	100.0	645.0
Plazo de vencimiento	88 d 31 d	30 d	86 d	85 d	94 d
Tasas de interés: Mínima	0.24 0.25	0.24	0.27	0.28	0.27
Máxima	0.24 0.28	0.25	0.28	0.28	0.28
Promedio	0.24 0.26	0.25	0.27	0.28	0.28
Saldo	42,948.4	43,708.4	43,836.4	43,931.4	44,431.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Junio del 2021	1,243.0	1,243.0	1,243.0	1,243.0	1,243.0
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de junio de 2021	0.0	0.0	0.0	1,243.0	1,243.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			Desierta	60.0	300.0
Propuestas recibidas			-	210.0	350.0
Plazo de vencimiento			88 d	85 d	94 d
Tasas de interés: Mínima			-	0.33	0.34
Máxima			-	0.37	0.38
Promedio			-	0.35	0.36
Saldo	1,998.5	1,998.5	1,998.5	1,998.5	1,998.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores al 2 de Agosto del 2021	1.5	10.0	1.5	1.5	1.5
Vencimiento de Repo Valores del 14 al 18 de junio de 2021	0.0	10.0	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 Repo de Cartera General					
Vencimiento de Repo de Cartera General el 11 de Junio del 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2,080.5	2,080.5	2,150.5	2,150.3	2,150.3
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Julio del 2021	0.5	0.5	0.5	0.5	0.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 14 al 18 de junio de 2021	0.0	0.0	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	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 Repo Especial - CDR del 14 al 18 de junio 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 14 al 18 de junio 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 14 al 18 de junio de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,000.0 13,448.6	1,721.7 13,702.6	1,333.2 14,787.0	1,288.3 11,168.7	1,093.4 14,385.7
Propuestas recibidas	1,000.0 13,448.6	1,721.7 13,702.6	1,333.2 14,787.0	1,288.3 11,168.7	1,093.4 14,385.7
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	0.24 0.24	0.24 0.24	0.24 0.24
Máxima	0.24 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	20,257.4	20,233.1	21,150.8	5,343.2	20,822.3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 14 de Junio del 2021	15,448.6	15,202.5	15,930.3	1,000.0	15,385.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de junio de 2021	16,757.4	17,531.4	17,095.0	5,343.2	20,822.3
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (CTV-TP-TP)			685.6		
Propuestas recibidas			180.0		
Plazo de vencimiento			0.30		
Tasas de interés: Mínima			0.63		
Máxima			0.32		
Promedio					
Saldo	3,820.5	3,820.5	4,287.3	4,287.3	4,287.3
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 14 al 18 de junio 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 14 al 18 de junio de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	200.0 70.0	Desierta		200.0	Desierta
Propuestas recibidas	261.0 70.0	-		220.0	
Plazo de vencimiento	62 d 60 d	62 d		61 d	61 d
Tasas de interés: Mínima	0.20 0.25	-		0.24	-
Máxima	0.25 0.25	-		0.25	-
Promedio	0.24 0.25	-		0.24	-
Saldo	7,018.8	7,008.8	6,978.8	7,048.8	7,048.8
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 de Junio del 2021	10.0	10.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 18 de junio de 2021	170.0	140.0	30.0	30.0	30.0
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 14 al 18 de junio 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 Repo Regular el 10 de Agosto del 2021	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de junio 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 14 al 18 de junio 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 14 al 18 de junio 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 14 al 18 de junio de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	31,429.1	30,419.0	30,116.0	29,998.0	29,998.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Junio del 2021	1,010.1	303.0	118.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de junio de 2021	1,431.1	421.0	118.0	200.0	200.0
xx. Subasta de Reso de Valores sara sroover dólares (REDI)	200.0		400.0 200.0 145.0	60.0	57.0
Propuestas recibidas	300.0		741.0 345.0 145.0	60.0	57.0
Plazo de vencimiento	14 d		14 d 14 d 14 d	14 d	14 d
Tasas de interés: Mínima	0.65		0.78 0.78 0.90	0.90	0.90
Máxima	0.85		0.88 0.77 0.79	0.79	0.81
Promedio	0.78		0.78 0.78 0.85	0.83	0.84
Saldo	3,135.0	2,935.0	3,680.0	3,540.0	3,597.0
Próximo vencimiento de REDI el 14 de Junio del 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
Vencimiento de REDI del 14 al 18 de junio de 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	1,895.0
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	1,150.2	322.6	0.0	152.1	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	293.0	81.0	0.0	39.0	0.0
Tipo de cambio promedio	3.9255	3.9826	0.0000	3.9012	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.3	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.3	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	39.2	145.1	143.1	16.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	39.2	145.1	143.1	16.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7,295.1**	**6,058.6**	**6,004.5**	**5,098.3**	**5,546.7**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Compra (tipo cambio digital)	0.00%-0.0%	0.00%-0.0%	0.00%-0.0%	0.00%-0.0%	0.00%-0.0%
b. Compra temporal directa de valores (tasa de subasta)					
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
c. Crédito por reputación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	**3,027.5**	**2,715.1**	**2,813.7**	**6,926.2**	**4,078.9**
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4,177.6**	**3,343.5**	**3,190.8**	**2,173.1**	**1,467.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	11,774.5	11,376.1	11,050.3	10,149.9	10,503.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.0	5.8	5.6	5.2	5.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5,783.2	5,405.6	5,083.8	4,879.2	4,540.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.9	2.7	2.6	2.5	2.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	60.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	104.0	88.0	58.0	160.0	252.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.40 / 0.50 / 0.50	0.00 / 0.50 / 0.46	0.01 / 0.60 / 0.49	0.01 / 0.80 / 0.78	0.80 / 0.80 / 0.80
c. Total mercado secundario de CDBCRP: CDBCRP-NR y CDV	70.0	6.0	91.4	0.0	10.0
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 04, 2021**	**Jun 07, 2021**	**Jun 08, 2021**	**Jun 09, 2021**	**Jun 10, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-215.2	193.9	-100.1	-34.0	54.2
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	36.0	322.9	166.6	-5.8	313.6
a. Mercado spot con el público	89.6	133.9	153.7	85.7	54.1
i. Compras	844.7	488.0	540.6	471.8	608.4
ii. (-) Ventas	754.1	366.1	387.4	388.1	385.3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	279.6	4.9	-96.6	-28.2	-266.2
i. Derechos	498.7	318.1	377.4	353.0	450.0
ii. (-) Vencidas	158.6	213.2	374.1	380.1	696.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	338.4	-0.7	-103.7	-60.1	-69.7
i. Derechos	516.8	343.5	343.4	333.3	337.7
ii. (-) Vencidas	178.4	244.3	267.1	221.3	297.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	348.2	207.5	230.3	392.7	358.9
ii. A futuro	36.0	44.0	70.0	20.0	53.0
e. Operaciones sont asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-311.5	-4.8	-248.0	-374.8	-254.4
i. Compras	120.8	189.9	211.0	184.6	240.4
ii. (-) Ventas	432.2	194.7	459.0	277.3	494.8
f. Efecto de operaciones	-3.1	1.4	-0.5	-8.4	-52.9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-102.7	100.8	-208.8	-137.3	106.0
h. Crédito por reputación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8159	3.9250	3.9592	3.8765	3.8890

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera