BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	14 Jun 21		15 Jun 21		16 Jun 21		17 Jun 21		18 Jun 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**22,308.9**		**20,860.4**		**24,625.6**		**20,603.0**		**23,749.7**	
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)	302.0	800.0	105.0		22.3		24.0		100.0	
Propuestas recibidas	318.0	838.0	215.0		122.3		24.0		120.0	
Plazo de vencimiento	91 d	30 d	29 d		30 d		32 d		94 d	
Tasas de interés: Mínima	0.28	0.24	0.24		0.25		0.24		0.28	
Máxima	0.28	0.25	0.25		0.25		0.25		0.28	
Promedio	0.28	0.25	0.25		0.25		0.25		0.28	
Saldo	44,290.4		44,395.4		44,417.7		44,441.7		44,541.7	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 21 de Junio del 2021	1,800.0		1,800.0		1,800.0		1,800.0		1,800.0	
Vencimiento de CD BCRP del 21 al 25 de junio de 2021	0.0		0.0		0.0		0.0		2,391.9	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	200.0		200.0						200.0	
Propuestas recibidas	270.0		240.0						200.0	
Plazo de vencimiento	91 d		90 d						94 d	
Tasas de interés: Mínima	0.35		0.33						0.33	
Máxima	0.36		0.35						0.34	
Promedio	0.36		0.34						0.34	
Saldo	9,488.5		6,688.5		6,688.5		6,688.5		6,888.5	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 7 de Agosto del 2021	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
Vencimiento de Repo Valores del 21 al 25 de junio de 2021	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 Repo de Cartera General										
Vencimiento de Repo de Cartera General el 18 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	2,130.4		2,330.3		2,330.3		2,330.3		2,330.3	
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 21 al 25 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 21 al 25 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 21 al 25 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 21 al 25 de junio de 2021										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,303.2	14,500.6	1,500.1	14,470.7	1,273.5	16,599.2	1,404.0	17,616.2	1,799.9	16,184.1
Propuestas recibidas	1,303.2	14,500.6	1,560.9	14,470.7	1,273.5	16,599.2	1,404.0	17,616.2	1,859.2	16,184.1
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	0.25	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	21,240.4		20,988.0		23,057.7		24,190.4		23,464.8	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Junio del 2021	16,222.3		15,803.9		17,887.5		18,709.6		17,487.3	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 21 al 25 de junio de 2021	16,957.3		18,185.6		18,960.0		18,709.6		21,464.8	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (CTS DTP)					500.0		552.3			
Propuestas recibidas					580.0		585.0			
Plazo de vencimiento					183 d		92 d			
Tasas de interés: Mínima					0.31		0.25			
Máxima					0.50		0.31			
Promedio					0.34		0.26			
Saldo	4,287.3		4,287.3		4,787.3		4,939.5		4,939.5	
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 21 al 25 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 21 al 25 de junio de 2021										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	Desierta								30.0	Desierta
Propuestas recibidas	---								60.0	---
Plazo de vencimiento	60 d								60 d	60 d
Tasas de interés: Mínima	---								0.25	---
Máxima	---								0.25	---
Promedio	---								0.25	---
Saldo	7,588.0		6,968.0		7,154.0		7,154.0		7,094.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Junio del 2021	850.0		150.0		150.0		150.0		150.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 21 al 25 de junio de 2021	590.0		150.0		150.0		150.0		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 21 al 25 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 21 al 25 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 21 al 25 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 21 al 25 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 21 al 25 de junio de 2021										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	29,998.0		29,998.0		29,798.0		29,798.0		29,798.0	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 22 de Junio del 2021	200.0		200.0		800.0		800.0		800.0	
Vencimiento de SC - Venta del 21 al 25 de junio de 2021	200.0		200.0		0.0		0.0		1,818.0	
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RSD)	90.0		400.0	200.0	155.0		100.0		78.0	
Propuestas recibidas	90.0		710.0	325.0	155.0		130.0		78.0	
Plazo de vencimiento	14 d		15 d	15 d	14 d		7 d		7 d	
Tasas de interés: Mínima	0.90		0.96	0.97	0.93		0.40		0.93	
Máxima	0.96		0.97	0.99	0.40		0.40		0.96	
Promedio	0.91		0.60	0.98	0.96		0.40		0.41	
Saldo	3,487.0		3,287.0		3,142.0		2,942.0		2,725.0	
Próximo vencimiento de RED el 21 de Junio del 2021	800.0		300.0		400.0		195.0		200.0	
Vencimiento de RED del 21 al 25 de junio de 2021	1,695.0		895.0		595.0		1,797.0		1,680.0	
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	0.0		354.0		0.0		0.0		7.9	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		90.0		0.0		0.0		2.0	
Tipo de cambio promedio	0.0000		3.9328		0.0000		0.0000		3.9550	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	15.7		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)	15.7		0.0		0.0		0.0		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)										
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,663.1**		**7,430.6**		**7,430.6**		**7,430.6**		**5,527.8**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)	0.00 / 0%		0.00 / 0%		0.00 / 0%		0.00 / 0%		0.00 / 0%	
(Tasas fijas efectivas diarias)										
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	**4,479.6**		**4,479.6**		5,125.5		4,287.0		4,129.0	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,123.5**		**1,452.3**		**1,305.1**		**1,494.1**		**1,398.8**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,812.1		9,598.6		9,483.8		9,383.4		9,273.0	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.0		4.9		4.8		4.7		4.7	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,860.4		3,648.3		3,525.4		3,424.3		3,310.9	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.0		1.9		1.8		1.7		1.7	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		0.0		0.0		45.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	244.0		257.5		149.5		173.7		132.1	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.80 / 0.80 / 0.80		0.80 / 0.80 / 0.80		0.40 / 0.80 / 0.62		0.50 / 0.60 / 0.57		0.50 / 0.60 / 0.54	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	50.0		0.0		2.6		0.0		50.0	
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 11, 2021**		**Jun 14, 2021**		**Jun 15, 2021**		**Jun 16, 2021**		**Jun 17, 2021**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-42.7		118.8		-0.6		7.4		44.0	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-51.7		-10.0		70.5		39.1		34.0	
a. Mercado spot con el público	118.7		154.3		64.5		49.6		64.9	
i. Compras	614.0		444.0		530.5		433.1		447.6	
ii. (-) Ventas	495.2		289.7		465.6		383.5		382.7	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-2.4		-78.6		-34.7		47.1		-166.3	
i. Derivados	340.3		196.4		208.1		377.1		373.9	
ii. (-) Ventas	242.7		274.0		242.8		330.0		540.2	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-43.3		-207.6		7.5		7.7		-176.4	
i. Derivados	231.3		479.7		236.8		329.8		195.5	
ii. (-) Ventas	274.4		687.3		228.2		322.1		371.9	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	339.5		288.8		273.8		203.0		177.1	
ii. A futuro	8.0		91.6		88.0		12.0		68.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-136.5		261.6		-45.7		-72.4		-200.0	
i. Compras	91.7		521.1		184.1		255.6		335.2	
ii. (-) Ventas	228.1		259.6		229.8		328.0		536.0	
f. Efecto de operaciones	0.1		-0.1		-28.9		-17.1		-0.1	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-44.1		-2.6		36.8		0.0		1.7	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9027		3.9086		3.9186		3.8983		3.9132	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera