BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	5 Jul 21		6 Jul 21		7 Jul 21		8 Jul 21		9 Jul 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**23,277.8**		**22,897.8**		**24,003.9**		**26,945.8**		**26,308.7**	
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)	100.0	500.0	199.0	65.0	199.9		200.0	400.0	200.0	600.0
Propuestas recibidas	184.0	570.0	249.0	75.0	502.5		434.0	911.5	305.0	1089.0
Plazo de vencimiento	94 d	31 d	93 d	30 d	92 d		91 d	28 d	90 d	27 d
Tasas de interés: Mínima	0.28	0.25	0.27	0.24	0.28		0.28	0.24	0.28	0.24
Máxima	0.28	0.25	0.28	0.25	0.28		0.28	0.25	0.28	0.25
Promedio	0.28	0.25	0.28	0.25	0.28		0.28	0.25	0.28	0.25
Saldo	43,491.0		41,623.0		41,822.9		38,380.6		39,180.6	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Julio del 2021	2,132.0		4,042.3		4,042.3		905.0		905.0	
Vencimiento de CD BCRP del 12 al 16 de julio de 2021	6,174.3		4,042.3		4,042.3		0.0		927.3	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	8,575.5		8,575.5		8,575.5		8,575.5		8,575.5	
Próximo vencimiento de Repo de Valores al 2 de Agosto del 2021	1.0		1.0		1.0		1.0		1.0	
Vencimiento de Repo Valores del 12 al 16 de julio 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 Reso de Cartera General										
Vencimiento de Reso de Cartera General el 9 de Julio del 2021										
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2,529.4		2,528.8		2,526.8		2,526.8		2,438.8	
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 13 de Setiembre del 2021	0.5		90.0		90.0		90.0		2.5	
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 12 al 16 de julio de 2021	90.5		90.0		90.0		90.0		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 12 al 16 de julio 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 12 al 16 de julio 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 12 al 16 de julio de 2021										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,500.1	14,700.4	1,500.0	13,856.1	1,499.5	14,429.0	1,360.4	19,700.1	1,144.0	19,732.9
Propuestas recibidas	2,084.0	15,187.6	1,871.1	13,856.1	1,499.5	14,499.0	1,360.4	20,117.9	1,144.0	19,732.9
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	0.25	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	20,200.3		20,856.0		21,428.4		27,060.0		26,736.9	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 12 de Julio del 2021	14,700.4		15,356.1		15,428.9		21,200.0		21,233.0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 12 al 16 de julio de 2021	18,700.2		17,855.9		18,928.8		21,300.0		26,736.9	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (CTS-DETI)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	4,939.5		4,939.5		4,939.5		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 12 al 16 de julio 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 12 al 16 de julio de 2021										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reasustables del BCRP (CDR BCRP)					200.0	300.0	160.0	Desierta	11.0	40.0
Propuestas recibidas					290.0	540.0	160.0	- -	11.0	40.0
Plazo de vencimiento					62 d	62 d	62 d	62 d	62 d	62 d
Tasas de interés: Mínima					0.22	0.22	0.22	- -	0.25	0.25
Máxima					0.23	0.23	0.24	- -	0.25	0.25
Promedio					0.23	0.23	0.23	- -	0.25	0.25
Saldo	9,434.0		9,434.0		9,668.8		9,908.8	9,908.8	9,915.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 17 de Julio del 2021	95.0		95.0		500.0		500.0	500.0	95.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 12 al 16 de julio de 2021	395.0		395.0		500.0		500.0	500.0	165.0	
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 12 al 16 de julio 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 12 al 16 de julio 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 12 al 16 de julio 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 Reso Expansion										
Vencimiento de REPO Expansión del 12 al 16 de julio 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 Reso Sustitucion										
Vencimiento de REPO Sustitución del 12 al 16 de julio de 2021										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	26,858.0		26,251.9		26,251.9		26,251.9		26,251.9	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Julio del 2021	606.1		191.0		191.0		191.0		191.0	
Vencimiento de SC - Venta del 12 al 16 de julio de 2021	606.1		0.0		0.0		0.0		191.0	
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (REDI)	200.0		200.0	200.0					68.0	
Propuestas recibidas	260.0		507.0	212.0					258.0	
Plazo de vencimiento	14 d		14 d	14 d					14 d	
Tasas de interés: Mínima	0.95		0.45	0.38					0.50	
Máxima	0.54		0.45	0.45					0.57	
Promedio	0.45		0.45	0.38					0.56	
Saldo	1,737.1		2,000.1		2,000.1		2,000.1		1,868.1	
Próximo vencimiento de REDI el 12 de Julio del 2021	137.0		0.0		0.0		200.0		0.0	
Vencimiento de REDI del 12 al 16 de julio de 2021	337.0		200.0		200.0		1,600.1		1,200.1	
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		395.3		0.0		318.3		95.3	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		100.0		0.0		80.0		24.0	
Tipo de cambio promedio	0.0000		3.9525		0.0000		3.9700		3.9700	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.4		0.0	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.4		0.0	
ii. Ventas (millones de US$)										
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valoriza)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6,477.3**		**6,882.5**		**7,215.5**		**4,987.0**		**4,405.6**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)	0.00000%		0.00000%		0.00000%		0.00000%		0.00000%	
Comisión (tasa efectiva diaria)										
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por reputación monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,918.9		2,942.6		3,379.5		2,251.7		2,525.6	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,558.4**		**3,939.9**		**3,836.0**		**2,715.3**		**1,880.0**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,746.8		11,228.5		11,678.7		11,202.9		10,814.5	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	5.3		5.6		5.8		5.5		5.3	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5,940.7		5,171.0		5,621.1		5,135.0		4,741.6	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	2.9		2.6		2.8		2.5		2.3	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de COBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		40.0		85.0		0.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	99.0		99.0		19.2		59.2		109.2	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.35 / 0.35 / 0.35		0.35 / 0.35 / 0.35		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.30 / 0.25	
c. Total mercado secundario de COBCRP: COBCRP-NR y CDV	30.0		50.0		41.4		280.0		40.0	
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$)	**Jul 02, 2021**		**Jul 05, 2021**		**Jul 06, 2021**		**Jul 07, 2021**		**Jul 08, 2021**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	127.1		-39.5		-18.0		-71.0		-25.2	
Flujo de la posición cambiaria = a + b.ii - c.ii + e + g	287.3		63.8		164.4		297.0		-22.4	
a. Mercado spot con el público	86.5		89.5		160.0		221.5		85.5	
i. Compras	456.5		358.6		391.8		431.0		276.7	
ii. (-) Ventas	369.6		269.2		209.8		209.6		342.0	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-114.4		-15.6		3.4		-121.6		-168.2	
i. Derechos	113.3		19.1		307.6		139.9		148.8	
ii. (-) Vencidas	228.6		34.7		304.2		242.5		338.0	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	56.9		87.8		20.4		246.3		-166.3	
i. Derechos	248.1		146.3		231.8		424.1		156.7	
ii. (-) Vencidas	191.2		58.3		211.5		177.8		323.0	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	255.3		43.0		356.9		392.5		573.2	
ii. A futuro	38.0		0.0		21.0		10.0		114.0	
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-104.8		7.4		-211.1		-140.9		-48.0	
i. Compras	113.6		2.1		85.6		97.3		282.5	
ii. (-) Ventas	218.5		5.3		296.7		240.2		330.5	
f. Efecto de operaciones	33.1		-3.1		1.6		43.1		-8.9	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	269.8		-3.5		-64.2		153.8		73.9	
h. Crédito por reputación monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8892		3.9139		3.9505		3.9548		3.9695	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera