BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	12 Jul 21		13 Jul 21		14 Jul 21		15 Jul 21		16 Jul 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**26,408.0**		**25,111.0**		**24,918.0**		**22,969.1**		**22,368.1**	
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)	96.0	500.0	500.1		200.0	500.0	80.0	200.1	43.0	100.0
Propuestas recibidas	311.0	975.0	634.3		278.0	767.1	90.0	288.0	53.0	127.2
Plazo de vencimiento	87 d	31 d	30 d		85 d	29 d	84 d	28 d	175 d	33 d
Tasas de interés: Mínima	0.28	0.25	0.25		0.27	0.24	0.28	0.25	0.31	0.25
Máxima	0.28	0.25	0.25		0.27	0.25	0.28	0.25	0.31	0.25
Promedio	0.28	0.25	0.25		0.27	0.25	0.28	0.25	0.31	0.25
Saldo	39,776.6		40,276.7		40,071.7		40,351.8		40,472.5	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Julio del 2021	905.0		905.0		22.3		22.3		24.0	
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 16 de julio de 2021	927.3		927.3		22.3		22.3		24.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	8,476.5		8,630.5		8,746.7		9,476.7		9,476.7	
Próximo vencimiento de Repo de Valores al 7 de Agosto del 2021	1.9		1.9		1.9		1.9		1.9	
Vencimiento de Repo Valores del 14 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 Repo de Cartera General										
Vencimiento de Repo de Cartera General al 14 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	2,438.8		2,438.8		2,438.8		2,438.8		2,637.0	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 13 de Setiembre del 2021	2.5		2.5		2.5		2.5		2.5	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 14 al 16 de julio 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 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 14 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 14 al 16 de julio de 2021										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 000.0	18 241.1	1 999.9	19 190.9	1 999.9	15 940.2	1 999.9	17 103.8	1 618.8	16 171.3
Propuestas recibidas	3 471.7	18 241.1	2 530.1	19 190.9	2 352.8	15 940.2	2 140.6	17 103.8	1 618.8	16 171.3
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	25,745.0		27,194.7		24,444.4		26,247.5		25,789.8	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 15 de Julio del 2021	19,741.1		20,680.4		17,300.6		18,247.8		18,171.3	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 16 de julio de 2021	19,741.1		20,680.4		17,300.6		18,247.8		18,171.3	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (TTP CETE)										
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 14 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 14 al 16 de julio de 2021										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	90.0									
Propuestas recibidas	90.0									
Plazo de vencimiento	63 d									
Tasas de interés: Mínima	0.25									
Máxima	0.25									
Promedio	0.25									
Saldo	8,580.0		8,580.0		8,580.0		8,999.0		8,695.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 15 de Julio del 2021	85.0		85.0		85.0		85.0		495.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 16 de julio de 2021	145.0		145.0		145.0		85.0		2,305.0	
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 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 14 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 14 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 Repo Expansion										
Vencimiento de REPO Expansión del 14 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 Repo Sustitución										
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 16 de julio de 2021										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP							50.0			
Propuestas recibidas							50.0			
Plazo de vencimiento							185 d			
Tasas de interés: Mínima							0.50			
Máxima							0.50			
Promedio							0.50			
Saldo	26,251.9		26,060.9		26,060.9		26,110.9		26,110.9	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 19 de Julio del 2021	191.0		205.0		205.0		205.0		205.0	
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 16 de julio de 2021	191.0		0.0		0.0		0.0		1,688.0	
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)	200.0		200.0		120.0		190.2	4.1	200.0	200.0
Propuestas recibidas	265.0		216.0		120.0		405.0	4.1	250.0	200.0
Plazo de vencimiento	14 d		14 d		15 d		15 d	15 d	14 d	14 d
Tasas de interés: Mínima	0.95		0.94		0.93		0.94	0.96	0.40	0.93
Máxima	0.97		0.96		0.96		0.96	0.97	0.40	0.96
Promedio	0.96		0.96		0.94		0.97	0.96	0.40	0.95
Saldo	2,068.1		2,268.1		2,388.1		1,782.3		1,782.3	
Próximo vencimiento de RED el 15 de Julio del 2021			800.1		800.1		400.0		200.0	
Vencimiento de RED del 14 al 16 de julio de 2021	1,200.1		1,200.1		1,200.1		400.0		668.0	
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		31.8		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		8.0							
Tipo de cambio promedio	0.0000		3.9780							
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	85.9		13.2		0.0		0.0		0.0	
i. Compras (millones de US$)	85.9		13.2							
ii. Ventas (millones de US$)										
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5,480.9**		**3,433.3**		**4,481.9**		**4,314.3**		**4,635.0**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)										
Cotización (tasa efectiva anual)	0.00%		0.00%		0.00%		0.00%		0.00%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)										
Tasa de interés	0.50%		0.50%		0.50%		0.50%		0.50%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,938.6		1,976.9		3,755.5		2,703.6		3,110.4	
Tasa de interés	0.15%		0.15%		0.15%		0.15%		0.15%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,542.3**		**1,456.4**		**2,648.4**		**1,610.7**		**1,524.6**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,026.2		9,990.8		9,742.8		9,764.2		9,571.2	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	4.9		4.9		4.8		4.8		4.7	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,956.6		3,898.7		3,646.7		3,659.6		3,466.7	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSE) (*)	1.9		1.9		1.8		1.8		1.7	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	302.0		0.0		0.0		70.0		30.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	138.6		119.6		300.0		110.5		0.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25	
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0		30.0		10.0		40.0		50.0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)										
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)										
7. Operaciones en mercado extranjero de las empresas bancarias (millones de US$)	**Jul 09, 2021**		**Jul 12, 2021**		**Jul 13, 2021**		**Jul 14, 2021**		**Jul 15, 2021**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	26.7		-56.2		21.0		-57.6		35.5	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-107.0		-94.2		-56.1		16.8		-85.5	
a. Mercado spot con el público	78.5		85.5		73.5		104.3		-47.7	
i. Compras	440.7		385.7		354.6		440.4		482.8	
ii. (-) Ventas	364.4		300.4		341.3		336.2		530.5	
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	-70.5		-112.3		-69.1		7.5		-137.1	
i. Compras	164.4		191.4		196.7		281.3		248.6	
ii. (-) Ventas	234.9		342.7		265.3		273.8		385.2	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-205.8		-149.5		-198.0		93.6		-244.2	
i. Compras	192.5		191.4		233.5		312.8		138.9	
ii. (-) Ventas	385.3		300.9		431.5		219.2		381.1	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	258.4		464.8		310.0		389.5		560.1	
ii. A futuro	25.0		55.0		23.0		83.0		130.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-39.6		-107.6		52.1		-115.4		-19.1	
i. (-) Compras	181.9		126.7		329.9		129.2		364.4	
ii. (-) Ventas	220.5		234.3		277.8		260.6		383.5	
f. Efecto de operaciones	-1.6		3.7		0.1		11.8		3.4	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-24.4		-23.6		-40.2		-10.7		-20.2	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9618		3.9559		3.9737		3.9628		3.9564	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera