BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	09 Ago 21	10 Ago 21	11 Ago 21	12 Ago 21	13 Ago 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,565.6**	**21,301.2**	**25,116.0**	**26,407.0**	**27,950.4**
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)		299.9	800.0	300.1	
Propuestas recibidas		674.0	855.0	349.0	
Plazo de vencimiento		31 d	30 d	29 d	
Tasas de interés: Mínima		0.25	0.25	0.25	
Máxima		0.25	0.25	0.25	
Promedio		0.25	0.25	0.25	
Saldo	38.090.9	38.390.8	39.190.8	37.790.7	37.790.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 16 de Agosto del 2021	1.700.2	1.700.2	1.700.2	2.109.0	2.109.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de ago de 2021	1.700.2	1.700.2	1.700.2	0.0	3.409.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	9.433.8	9.433.8	9.433.8	9.433.8	9.613.5
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Setiembre del 2021	60.0	60.0	60.0	60.0	60.0
Vencimiento de Repo Valores del 16 al 20 de ago 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 del 16 al 20 de ago de 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2.838.1	2.838.1	2.838.1	2.838.1	2.838.1
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 16 al 20 de ago 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 16 al 20 de ago 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 16 al 20 de ago 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 16 al 20 de ago de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	840.1 14.600.0	500.1 15.400.1	439.0 18.350.0	477.1 20.974.9	2.999.9 18.239.7
Propuestas recibidas	840.1 16.494.6	600.0 15.713.9	439.0 18.350.0	477.1 20.974.9	3.469.5 18.239.7
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	0.25 0.25
Máxima	0.25 0.25	0.25 0.25	0.25 0.25	0.25 0.25	0.50 0.50
Promedio	0.25 0.25	0.25 0.25	0.25 0.25	0.25 0.25	0.50 0.42
Saldo	21.837.7	21.740.4	24.129.2	25.731.2	23.495.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de Agosto del 2021	15.997.5	16.400.2	19.850.0	23.474.9	19.079.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 16 al 20 de ago de 2021	20.997.6	20.400.2	22.350.0	23.474.9	23.495.9
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
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 16 al 20 de ago de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	275.0
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 16 al 20 de ago de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)		200.0 80.0 510.0 200.0 200.0 200.0 300.0	10.0 80.0		40.0
Propuestas recibidas		220.0 80.0 510.0 465.0 380.0 570.0 450.0	10.0 80.0		40.0
Plazo de vencimiento		63 d 63 d 63 d 64 d 64 d 92 d 92 d	93 d 63 d		61 d
Tasas de interés: Mínima		0.60 0.60 0.59 0.59 0.60 0.41 0.55	0.60 0.60		0.60
Máxima		0.60 0.60 0.60 0.60 0.60 0.59 0.60	0.60 0.60		0.60
Promedio		0.60 0.60 0.60 0.60 0.60 0.44 0.57	0.60 0.60		0.60
Saldo	6.620.0	8.110.0	7.870.0	7.790.0	7.646.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 16 de Agosto del 2021	200.0	330.0	80.0	184.0	186.0
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 20 de ago de 2021	794.0	594.0	264.0	184.0	1.235.0
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 16 al 20 de ago 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	1.872.0	1.872.0	1.872.0	1.872.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Setiembre del 2021	50.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de ago de 2021	50.0	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 16 al 20 de ago 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 16 al 20 de ago 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 16 al 20 de ago de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			101.0 60.0		200.0 400.0 260.0 400.1 100.0
Propuestas recibidas			131.0 60.0		220.0 860.0 310.0 501.5 100.0
Plazo de vencimiento			93 d 63 d		91 d 31 d 91 d 31 d 91 d
Tasas de interés: Mínima			0.60 0.60		0.60 0.50 0.59 0.58 0.59
Máxima			0.60 0.60		0.60 0.60 0.60 0.60 0.60
Promedio			0.60 0.60		0.60 0.59 0.60 0.60 0.60
Saldo	24.325.9	24.325.9	24.486.9	24.486.9	25.847.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 de Agosto del 2021	580.1	580.1	580.1	580.1	580.1
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de ago de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	1.618.1
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)	119.0	119.0		200.0	105.0
Propuestas recibidas	119.0	119.0		200.0	105.0
Plazo de vencimiento	14 d	14 d		14 d	14 d
Tasas de interés: Mínima	0.38	0.38		0.38	0.40
Máxima	0.42	0.42		0.38	0.40
Promedio	0.38	0.38		0.38	0.40
Saldo	2.249.1	1.889.1	1.889.1	2.089.1	1.794.0
Próximo vencimiento de RED el 16 de Agosto del 2021	360.0	400.1	400.1	400.1	395.0
Vencimiento de RED del 16 al 20 de ago de 2021	760.1	400.1	400.1	400.1	1.150.0
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	599.5	57.1	474.4	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	146.0	14.0	116.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	4.1065	4.0800	4.0894	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.3	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.3	0.0	0.0	0.0	
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**5.526.0**	**3,354.0**	**4,962.6**	**4,654.9**	**6,670.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0013%	0.0013%	0.0013%	0.0013%	0.0029%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	1.00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1.925.6	1.728.0	1.651.8	1.835.3	3.895.8
Tasa de interés	0.15%	0.15%	0.15%	0.15%	0.35%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,600.4**	**1,626.0**	**3,310.8**	**2,819.6**	**2,775.0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10.228.5	10.162.2	9.755.9	9.894.7	9.781.4
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.0	5.0	4.8	4.9	4.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4.126.9	4.055.5	3.654.4	3.766.2	3.655.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.0	2.0	1.8	1.8	1.8
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	100.0	133.0	395.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.50 / 0.50 / 0.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	75.0	65.0	110.0	5.0	101.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.35 / 0.35 / 0.35	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	50.5
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$)	**Ago 06, 2021**	**Ago 09, 2021**	**Ago 10, 2021**	**Ago 11, 2021**	**Ago 12, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	156.0	24.0	12.2	104.5	53.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	285.8	61.0	264.3	87.2	149.1
a. Mercado spot con el público	84.9	-97.1	-115.6	35.4	179.8
i. Compras	392.9	282.2	334.1	332.2	596.4
ii. (-) Ventas	308.0	379.3	449.7	296.8	416.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-41.5	177.5	-90.9	81.5	-324.6
i. Pactadas	105.2	252.1	185.0	298.8	274.8
ii. (-) Vencidas	146.7	74.6	275.9	217.3	599.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	78.1	219.2	162.6	100.3	-230.6
i. Pactadas	173.9	285.6	303.0	252.9	88.9
ii. (-) Vencidas	95.8	66.4	140.3	152.7	319.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	256.7	288.6	330.8	457.3	435.3
ii. A futuro	37.0	26.0	22.0	44.0	37.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	0.4	-6.3	-136.8	-66.2	-265.4
i. Compras	73.0	63.7	138.5	150.3	311.4
ii. (-) Ventas	72.6	70.1	275.3	216.5	576.8
f. Efecto de Opciones	0.3	4.7	1.5	-3.3	-1.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	139.1	156.2	381.1	92.8	-45.2
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0928	4.1060	4.0633	4.0895	4.0980
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera