BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	23 Ago 21	24 Ago 21	25 Ago 21	26 Ago 21	27 Ago 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**19,863.0**	**21,987.4**	**22,786.9**	**22,112.0**	**20,170.4**
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)		76.0	21.0	61.0 100.0	
Propuestas recibidas		122.0	61.0	61.0 117.0	
Plazo de vencimiento		86 d	85 d	84 d 34 d	
Tasas de interés: Mínima		0.53	0.51	0.56 0.50	
Máxima		0.56	0.56	0.60 0.50	
Promedio		0.54	0.54	0.57 0.50	
Saldo	34.875.7	32.681.7	32.752.7	33.013.7	33.013.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Setiembre del 2021	2.320.0	1.617.9	1.617.9	1.617.9	1.807.9
Vencimiento de CD BCRP del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	2.320.0	0.0	0.0	0.0	2.820.9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	8.725.4	8.725.4	8.725.4	7.725.4	7.825.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 31 de Agosto del 2021	60.0	60.0	1.000.0	60.0	100.0
Vencimiento de Repo Valores del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	0.0	0.0	1.000.0	0.0	160.0
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 31 de ago al 03 desetiembre 2021					
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2.837.5	2.836.4	2.836.4	2.886.4	2.885.7
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 31 de ago al 03 desetiembre 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 31 de ago al 03 desetiembre 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	100.0		300.0	300.0	300.0
Propuestas recibidas	150.0		470.0	430.0	380.0
Plazo de vencimiento	87 d		85 d	84 d	95 d
Márgen: Mínima	0.0		0.0	0.0	0.0
Máxima	0.0		0.0	0.0	0.0
Promedio	0.0		0.0	0.0	0.0
Saldo	250.0	250.0	550.0	850.0	1150.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de noviembre de 2021	250.0	250.0	550.0	850.0	850.0
Vencimientos de CDV BCRP del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 31 de ago al 03 desetiembre 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1.746.5 14.899.9	1.384.0 16.999.8	1.999.9 17.400.0	2.500.2 15.649.8	2.000.1 15.118.0
Propuestas recibidas	1.746.5 14.972.2	1.384.0 16.999.8	2.814.5 17.428.1	2.959.5 15.649.8	2.798.5 15.118.0
Plazo de vencimiento	8 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 4 d
Tasas de interés: Mínima	0.49 0.42	0.49 0.48	0.49 0.48	0.49 0.25	0.49 0.49
Máxima	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50
Promedio	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.50	0.50 0.49	0.50 0.50
Saldo	24.146.5	25.630.6	26.030.8	24.780.6	24.748.7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Agosto del 2021	16.899.7	18.999.7	19.400.2	17.150.0	18.248.5
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	22.400.0	22.500.1	20.900.4	17.150.0	24.748.7
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4.664.5	4.664.5	4.664.5	4.664.5	4.664.5
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 17 de Setiembre del 2021	152.2	152.2	152.2	152.2	152.2
Vencimiento de Coloc-TP del 31 de ago al 03 desetiembre 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 31 de ago al 03 desetiembre 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7.126.0	6.996.0	6.896.0	6.796.0	6.796.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 31 de Agosto del 2021	130.0	100.0	100.0	660.0	660.0
Vencimiento de CDR BCRP del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	330.0	200.0	100.0	0.0	1.160.0
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 31 de ago al 03 desetiembre 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.872.0	1.872.0	1.872.0	1.872.0	1.872.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Setiembre del 2021	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 31 de ago al 03 desetiembre 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 31 de ago al 03 desetiembre 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 31 de ago al 03 desetiembre 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 31 de ago al 03 desetiembre 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	59.0	165.0	200.0 125.0		200.0 140.0
Propuestas recibidas	59.0	165.0	212.0 125.0		235.0 140.0
Plazo de vencimiento	31 d	62 d	30 d 61 d		61 d 62 d
Tasas de interés: Mínima	0.60	0.60	0.60 0.60		0.60 0.60
Máxima	0.60	0.60	0.60 0.60		0.60 0.60
Promedio	0.60	0.60	0.60 0.60		0.60 0.60
Saldo	25.599.9	25.764.9	26.089.9	26.089.9	26.429.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Setiembre del 2021	379.5	379.5	379.5	379.5	379.5
Vencimiento de SC - Venta del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	1.129.7
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)	165.0			158.0	94.0
Propuestas recibidas	180.0			158.0	94.0
Plazo de vencimiento	14 d			14 d	14 d
Tasas de interés: Mínima	0.30			0.35	0.35
Máxima	0.38			0.40	0.35
Promedio	0.34			0.35	0.35
Saldo	825.0	825.0	825.0	783.0	772.0
Próximo vencimiento de RED el 31 de Agosto del 2021	200.0	200.0	200.0	105.0	355.0
Vencimiento de RED del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	305.0	305.0	305.0	105.0	355.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0	200.0 300.0	300.0 399.9	300.0 400.0	400.0 150.0
Propuestas recibidas	490.0	550.0 800.0	750.0 1650.0	800.0 1400.0	1600.0 1197.0
Plazo de vencimiento	92 d	92 d 184 d	92 d 184 d	92 d 184 d	184 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	0.65	0.66 0.75	0.72 0.82	0.72 0.85	0.87 1.00
Máxima	0.65	0.66 0.75	0.72 0.82	0.75 0.86	0.88 1.00
Promedio	0.65	0.66 0.75	0.72 0.82	0.74 0.86	0.88 1.00
Saldo	100.0	600.0	1.299.9	9.299.9	2.549.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 23 de Noviembre del 2021	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 31 de ago al 03 desetiembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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	0.0	0.0	0.0	20.4
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	5.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	4.0820
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.3	0.0	0.0	0.0	0.9
i. Compras (millones de US$)	0.3	0.0	0.0	0.0	0.9
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3.216.6**	**3.527.6**	**3.066.0**	**3.401.0**	**2.831.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0028%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2.234.4	2.648.0	2.195.2	2.768.6	1.818.7
Tasa de interés	0.35%	0.35%	0.35%	0.35%	0.35%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**982.2**	**879.6**	**870.8**	**632.4**	**1.013.2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8.843.3	8.783.4	8.706.2	8.643.5	8.569.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.3	4.3	4.3	4.2	4.2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2.695.6	2.634.1	2.559.8	2.494.6	2.416.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.3	1.3	1.3	1.2	1.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	600.0	660.0	695.0	705.0	680.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.55 / 0.50	0.50 / 0.55 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	233.0	262.0	212.0	137.0	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	0.0	0.0	80.4	240.4
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 20, 2021**	**Ago 23, 2021**	**Ago 24, 2021**	**Ago 25, 2021**	**Ago 26, 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	26.6	-46.4	40.3	25.8	25.8
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	398.2	-110.3	-96.2	-24.2	-56.5
a. Mercado spot con el público	160.9	-60.6	-130.7	88.7	39.4
i. Compras	491.4	275.0	316.1	541.9	820.5
ii. (-) Ventas	330.5	335.6	446.8	453.2	781.1
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	1.9	179.9	182.3	-57.6	-137.6
i. Pactadas	134.1	269.2	825.8	188.7	302.2
ii. (-) Vencidas	132.2	89.4	643.5	246.4	439.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	427.8	129.2	86.1	-50.3	-220.0
i. Pactadas	474.1	271.3	240.4	181.9	232.2
ii. (-) Vencidas	46.3	142.1	154.3	232.2	452.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	284.9	272.0	610.7	271.2	358.1
ii. A futuro	0.0	26.0	32.0	26.0	20.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-46.7	46.5	-424.7	-92.5	-55.3
i. Compras	42.5	90.4	153.3	127.9	380.2
ii. (-) Ventas	89.2	43.9	578.1	220.5	435.5
f. Efecto de Opciones	-0.4	-1.2	-0.1	-22.0	0.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	252.7	-29.1	10.4	44.7	-28.3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.1128	4.1073	4.0917	4.0966	4.0948
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera