BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Set 21	28 Set 21	29 Set 21	30 Set 21	01 Oct 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,716.5**	**21,212.3**	**19,934.0**	**21,097.8**	**18,785.5**
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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	20,136.5	20,136.5	19,986.5	19,986.5	19,807.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Octubre del 2021	150.0	150.0	179.5	179.5	1,774.9
Vencimiento de CD BCRP del 04 al 07 de Octubre. 2021	329.5	329.5	179.5	179.5	1,274.9
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,590.5	5,590.5	5,490.5	6,470.5	6,440.5
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 4 de Octubre del 2021	100.0	100.0	2,000.0	30.0	2,000.0
Vencimiento de Reso Valores del 04 al 07 de Octubre. 2021	100.0	100.0	0.0	30.0	2,000.0
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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Reso de Cartera General del 04 al 07 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	3,565.6	3,764.9	3,964.5	4,514.5	4,524.8
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativo el 15 de Octubre del 2021	0.3	0.3	0.3	0.3	0.3
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativo del 04 al 07 de Octubre. 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 (Resular)					
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 04 al 07 de Octubre. 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	300.0	210.0			
Propuestas recibidas	430.0	220.0			
Plazo de vencimiento	92 d	91 d			
Mínimo: Mínima	0.00	0.00			
Máxima	0.00	0.04			
Promedio	0.00	0.02			
Saldo	8734.9	8584.9	8584.9	8584.9	8584.9
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 25 de Octubre del 2021	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimientos de CDV BCRP del 04 al 07 de Octubre. 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 04 al 07 de Octubre. 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 649.0 15 179.5	2 000.0 14 376.5	1 757.4 13 908.0	1 488.4 14 465.8	11 700.1
Propuestas recibidas	1 649.0 15 179.5	2 010.5 14 376.5	1 757.4 13 908.0	1 488.4 14 465.8	12 605.9
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	n.ne n.ne	n.ne n.ne	n.ne n.ne	n.ne n.ne	n.ne
Máxima	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00
Promedio	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00
Saldo	23,126.2	22,478.0	22,076.5	22,860.8	18,594.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 4 de Octubre del 2021	17,024.7	16,066.9	15,168.9	15,966.0	13,349.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 04 al 07 de Octubre. 2021	21,477.2	18,876.0	16,635.1	15,966.0	18,594.9
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,512.3	4,512.3	4,512.3	4,512.3	4,512.3
Próximo vencimiento de Colocs TP el 8 de Noviembre del 2021	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Vencimiento de Colocs TP del 04 al 07 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Colocación TP en M.N. del Tesoro de la Merced					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Colocs-BN					
Vencimiento de Colocs - BN del 04 al 07 de Octubre. 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,366.0	4,366.0	4,366.0	4,366.0	4,496.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 4 de Octubre del 2021	380.0	380.0	380.0	390.0	270.0
Vencimiento de CDR BCRP del 04 al 07 de Octubre. 2021	770.0	770.0	770.0	390.0	270.0
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 04 al 07 de Octubre. 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,842.0	1,842.0	1,842.0	1,842.0	1,842.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 15 de Octubre del 2021	40.0	40.0	40.0	40.0	40.0
Vencimiento de REPO del 04 al 07 de Octubre. 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 Reso					
Próximo vencimiento de REPO del 04 al 07 de Octubre. 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 04 al 07 de Octubre. 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 04 al 07 de Octubre. 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 200.0 200.0 200.0	200.0 200.0 200.0 200.0	200.0 200.0 200.0	100.0 150.0 200.0 200.0 200.0 200.0	200.0 200.0 200.1 168.0
Propuestas recibidas	445.0 550.0 350.0 500.0	665.0 200.0 700.0 600.0	500.0 400.0 500.0	100.0 150.0 541.0 475.0 470.0 200.0	280.0 380.0 415.0 168.0
Plazo de vencimiento	273 d 273 d 182 d 273 d	273 d 181 d 273 d 273 d	272 d 274 d 274 d	273 d 273 d 91 d 182 d 91 d	182 d 182 d 273 d 94 d
Tasas de interés: Mínima	0.55 0.53 0.55 0.54	0.53 0.54 0.50 0.50	0.50 0.50 0.51	0.50 0.57 0.50 0.50 0.50 0.54	0.55 0.51 0.49 0.49
Máxima	0.55 0.54 0.56 0.54	0.54 0.56 0.51 0.51	0.53 0.52 0.52	0.50 0.60 0.51 0.52 0.51 0.57	0.57 0.53 0.50 0.55
Promedio	0.55 0.54 0.56 0.54	0.53 0.55 0.51 0.51	0.52 0.52 0.52	0.50 0.58 0.51 0.51 0.50 0.56	0.56 0.52 0.49 0.51
Saldo	28,966.1	27,766.1	28,366.1	29,416.1	30,144.2
Próximo de SC Venta el 12 de Octubre del 2021	40.0	40.0	40.0	40.0	100.0
Vencimiento de SC - Venta del 04 al 07 de Octubre. 2021	40.0	40.0	40.0	40.0	0.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)		200.0			
Propuestas recibidas		200.0			
Plazo de vencimiento		14 d			
Tasas de interés: Mínima		0.30			
Máxima		0.30			
Promedio		0.30			
Saldo	595.0	595.0	595.0	400.0	400.0
Próximo vencimiento de RED el 7 de Octubre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de RED del 04 al 07 de Octubre. 2021	395.0	395.0	395.0	0.0	200.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0 400.0 300.0	100.0 400.0 300.0	100.0 400.0 300.0	100.0 400.0 300.0	100.0 400.0 300.0
Propuestas recibidas	400.0 1600.0 1200.0	400.0 1600.0 1300.0	400.0 1400.0 1300.0	300.0 1300.0 1200.0	400.0 1400.0 960.0
Plazo de vencimiento	91 d 181 d 273 d	91 d 181 d 273 d	91 d 181 d 273 d	91 d 181 d 273 d	92 d 182 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	1.27 1.66 1.90	1.30 1.72 1.98	1.32 1.75 2.11	1.36 1.80 2.26	1.38 1.91 2.17
Máxima	1.27 1.66 1.90	1.30 1.72 2.01	1.32 1.76 2.11	1.36 1.82 2.26	1.38 1.93 2.36
Promedio	1.27 1.66 1.90	1.30 1.72 1.99	1.32 1.76 2.11	1.36 1.81 2.26	1.38 1.92 2.25
Saldo	14,849.9	15,649.9	16,449.9	17,249.9	18,049.9
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 04 al 07 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Liquid. Reos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones Cambiarias de la Mesa de Negociación del BCR	755.1	1,172.2	784.5	2,021.5	251.9
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	183.0	284.0	190.0	489.0	61.0
Tipo de cambio promedio	4.1280	4.1275	4.1287	4.1340	4.1300
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	600.0	0.0	0.0	-44.0	-171.7
i. Compras (millones de US$)	600.0	0.0	0.0	1.0	2.3
ii. Ventas (millones de US$)				45.0	174.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP + CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (valorizado)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,221.9**	**3,453.5**	**3,484.1**	**3,166.1**	**7,085.1**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal directa de valores (subasta)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0045%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,444.0	2,513.1	2,786.7	2,399.7	818.3
Tasa de interés	0.85%	0.85%	0.85%	0.85%	0.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**788.9**	**940.4**	**697.4**	**766.4**	**6,186.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,933.3	8,671.2	8,419.7	8,172.6	8,162.5
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% de TOSEL) (*)	21.0	21.0	21.0	21.0	21.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,518.0	2,457.5	2,410.4	2,345.2	2,296.5
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% de TOSEL) (*)	1.2	1.2	1.2	1.2	1.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CRBP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	230.0	210.0	40.0	946.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
c. Total mercado secundario de CRBP (CD, CDLD y CDV)	0.0	1.0	0.0	2.0	0.0
Plazo 0 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones cambiarias interbancarias (millones de US$)	**Set 24, 2021**	**Set 27, 2021**	**Set 28, 2021**	**Set 29, 2021**	**Set 30, 2021**
Saldo de la posición global: a = b + c + d + e	48.7	50.7	56.4	124.5	124.6
Flujo de la posición contable: = a + b.1 - c.1 + e + o	-5.1	49.7	213.4	127.1	216.9
a. Mercado spot con el público	-107.1	37.0	49.0	-34.9	-118.5
i. Compras	500.4	292.7	259.2	355.2	382.4
ii. (-) Ventas	607.5	255.6	348.2	389.7	500.9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-34.9	41.5	-133.5	-55.1	-236.4
i. Pactadas	142.2	156.0	151.1	187.3	145.1
ii. (-) Vencidas	167.1	114.7	284.3	237.3	381.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	125.5	244.9	257.0	245.5	-108.7
i. Pactadas	215.9	384.0	430.9	366.8	418.6
ii. (-) Vencidas	90.4	139.1	173.9	121.3	527.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	354.7	263.9	267.2	422.1	352.7
ii. Al futuro	59.5	26.0	30.0	10.0	11.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-77.5	21.2	-93.4	-144.1	-112.9
i. Compras	89.5	131.9	173.1	87.6	247.1
ii. (-) Ventas	165.5	110.7	265.5	231.1	575.0
f. Efecto de Opciones	0.1	-0.8	-0.6	-1.2	-1.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	200.0	209.7	479.3	335.0	647.8
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.1085	4.1258	4.1270	4.1281	4.1345

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera