BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	18 Oct 21	19 Oct 21	20 Oct 21	21 Oct 21	22 Oct 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**19,954.8**	**19,699.4**	**18,431.6**	**16,605.9**	**16,298.2**
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	300.0				
Plazo de vencimiento	536.0				
Tasas de interés: Mínima	1.50				
Máxima	1.50				
Promedio	1.50				
Saldo	16,058.0	16,058.0	16,058.0	16,058.0	16,058.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 26 de Octubre del 2021	173.0	173.0	173.0	173.0	173.0
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 29 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	173.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,073.3	4,073.3	3,913.3	4,113.3	4,113.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Enero del 2022	160.0	160.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo Valores del 25 al 29 de octubre de 2021	160.0	160.0	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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 25 al 29 de octubre de 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	5,013.5	5,013.5	5,013.5	5,013.5	5,012.4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 12 de Enero del 2022	1.6	1.6	1.6	1.6	1.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 25 al 29 de octubre 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)					
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 25 al 29 de octubre de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	150.0	200.0 200.0	200.0 160.0		
Propuestas recibidas	575.0	545.0 710.0	754.0 710.0		
Plazo de vencimiento	91 d	90 d 35 d	89 d 34 d		
Mínimo: Mínima	0.00	0.04 0.00	0.04 0.00		
Máxima	0.02	0.04 0.00	0.04 0.00		
Promedio	0.02	0.04 0.00	0.04 0.00		
Saldo	98,574.9	100,024.9	100,024.9	100,024.9	100,024.9
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 25 al 29 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	100.0
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 25 al 29 de octubre de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 999.8 13 150.0	1 999.9 13 600.1	2 000.1 12 564.2	1 493.0 11 299.9	1 500.0 12 251.1
Propuestas recibidas	2 710.6 13 656.2	2 344.0 13 886.8	2 369.8 12 564.2	1 493.0 12 783.2	1 932.6 12 251.1
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 3 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	1.50 1.45	1.45 1.45	1.45 1.45	1.45 1.45	1.45 1.45
Máxima	1.55 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50
Promedio	1.49 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49
Saldo	23,466.6	22,916.8	21,381.2	20,192.9	21,243.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 25 de Octubre del 2021	16,149.8	16,099.9	13,981.2	12,700.1	14,250.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 25 al 29 de octubre de 2021	21,466.6	16,917.1	15,381.4	12,700.1	21,243.9
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 Coloc-TP el 8 de Noviembre del 2021	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 25 al 29 de octubre 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 Colac-BN					
Vencimiento de Colac - BN del 25 al 29 de octubre de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	200.0	200.0 200.0			
Propuestas recibidas	500.0	500.0 500.0			
Plazo de vencimiento	92 d	92 d 92 d			
Tasas de interés: Mínima	0.60	0.60 0.60			
Máxima	0.60	0.60 0.60			
Promedio	0.60	0.60 0.60			
Saldo	7,796.0	7,796.0	7,796.0	7,796.0	7,796.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 2 de Noviembre del 2021	150.0	150.0	150.0	150.0	436.0
Vencimiento de CDR BCRP del 25 al 29 de octubre de 2021	150.0	150.0	150.0	150.0	0.0
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					
Vencimiento de CD BCRP del 25 al 29 de octubre de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,942.0	1,902.0	1,902.0	1,902.0	1,902.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 5 de Noviembre del 2021	40.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 25 al 29 de octubre de 2021	40.0	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 25 al 29 de octubre 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 Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 25 al 29 de octubre 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 25 al 29 de octubre de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	50.0 80.0 200.0 200.0 200.0	30.0	200.0	39.5 200.0 200.0	300.0 200.0 200.0 40.0
Propuestas recibidas	50.0 80.0 219.8 499.8 250.0	30.0	230.0	39.5 490.0 380.0	320.0 260.0 230.0 40.0
Plazo de vencimiento	182 d 182 d 273 d 273 d 273 d	182 d	273 d	273 d 273 d 273 d	273 d 273 d 181 d
Tasas de interés: Mínima	0.57 0.58 0.53 0.50 0.57	0.60	0.57	0.51 0.45 0.49	0.50 0.50 0.52 0.60
Máxima	0.60 0.60 0.56 0.53 0.60	0.60	0.60	0.51 0.50 0.54	0.58 0.55 0.55 0.60
Promedio	0.59 0.59 33,592.2 0.51 0.58	0.60	0.60	0.51 33,441.7 0.51	0.56 0.53 0.53 0.60
Saldo	98.0	33,024.2	33,224.2	519.9	33,663.9
Próximo vencimiento de SC- Venta del 25 de Octubre del 2021	98.0	100.0	100.0	519.9	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 25 al 29 de octubre de 2021	717.9	619.9	619.9	519.9	2,043.9
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (REDI)				200.0	
Propuestas recibidas				200.0	
Plazo de vencimiento				14 d	
Tasas de interés: Mínima				0.30	
Máxima				0.30	
Promedio				0.30	
Saldo	400.0	400.0	400.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de REDI el 28 de Octubre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REDI del 25 al 29 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	200.0	400.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0 300.0 100.0	50.0 100.0 300.0	100.0 0.0 50.0	100.0 150.0 100.0	100.0 100.0 100.0
Propuestas recibidas	300.0 850.0 100.0	150.0 200.0 600.0	300.0 300.0	200.0 350.0 200.0	100.0 100.0 100.0
Plazo de vencimiento	92 d 182 d 273 d	92 d 182 d 273 d	182 d 273 d	92 d 182 d 273 d	92 d 182 d 182 d
Tasas de interés: Mínima	1.71 2.01 2.21	1.75 2.02 2.20	2.02 2.20	1.72 2.02 2.20	2.03 2.03 2.03
Máxima	1.73 2.01 2.25	1.75 2.02 2.20	2.02 2.20	1.74 2.02 2.20	2.03 2.03 2.03
Promedio	1.72 2.01 2.24	1.75 2.02 2.20	2.02 2.20	1.73 2.02 2.20	2.03 2.03 2.03
Saldo	20,669.9	21,119.9	21,269.9	21,619.9	21,719.9
Próximo vencimiento de Swaps 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 25 al 29 de octubre de 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 de Mesa de Negociación del BCR	355.5	0.0	0.0	4.0	186.5
i. Contratos (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	90.0	0.0	0.0	1.0	47.0
Tipo de cambio promedio	3.9469	0.0000	0.0000	3.9550	3.9680
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	6.2	0.0	0.4	0.1	3.6
i. Compras (millones de US$)	6.2	0.0	0.4	0.1	3.6
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Vencimiento)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,799.5**	**3,299.4**	**3,567.3**	**3,899.0**	**2,348.6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra Temporal de Valores (repo) (vencen)					
Contraído Tasa efectiva diaria	0.0064%	0.0064%	0.0064%	0.0064%	0.0055%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,133.1	1,893.1	2,327.3	2,473.0	1,457.9
Tasa de interés	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,666.4**	**1,406.3**	**1,180.0**	**1,136.0**	**890.7**
a. Fondo de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,096.4	9,971.9	9,828.0	9,685.5	9,565.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado requerido (millones de S/)	9,977.8	9,971.9	9,828.0	9,685.5	9,565.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4,077.9	3,952.7	3,812.4	3,678.3	3,547.0
d. Exceso de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2.0	2.0	1.8	1.8	1.8
6. Mercado interbancario y mercado sucursales de FINDETER					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	80.0	55.0	0.0	240.0	115.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	215.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado interbancario de FINDETER (FINDETER-MID y FTM)	0.0	15.0	0.0	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones cambiarias interbancarias (millones de US$)	**Oct 15, 2021**	**Oct 18, 2021**	**Oct 19, 2021**	**Oct 20, 2021**	**Oct 21, 2021**
Saldo de la posición global = a + b + c + d + e	-179.1	19.7	-0.4	-99.4	-27.4
Flujo de la posición contable = a + b.1 - c.1 + d + e = 0	34.0	15.9	17.1	-117.2	-150.0
a. Mercado spot con el público	-39.4	-68.6	-80.5	-133.2	-57.7
i. Compras	322.3	271.4	265.1	261.1	328.8
ii. (-) Ventas	361.7	339.9	345.6	394.3	386.5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-4.9	-28.6	25.6	37.4	-102.9
i. Pactadas	156.6	305.2	203.5	268.0	313.5
ii. (-) Vencidas	161.5	333.7	180.5	240.6	651.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	209.0	148.0	22.0	25.1	-378.1
i. Pactadas	292.2	447.1	270.6	280.0	276.3
ii. (-) Vencidas	83.2	299.1	248.6	254.9	654.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Compras	291.6	339.1	390.3	265.6	634.8
ii. A futuro	0.0	0.0	29.0	15.0	20.0
e. Operaciones swd asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-66.0	-39.4	63.5	18.2	-8.6
i. Compras	80.5	348.3	347.7	350.3	238.5
ii. (-) Ventas	146.3	307.7	180.3	232.1	647.0
f. Efecto de Opciones	1.4	-0.7	-1.5	24.8	0.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	226.5	284.3	85.0	62.7	5.2
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9325	3.9484	3.9450	3.9428	3.9508

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera