BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	15 Nov 21	16 Nov 21	17 Nov 21	18 Nov 21	19 Nov 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,934.1**	**19,781.8**	**17,768.1**	**17,868.9**	**16,004.6**
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)	500.0	300.0			
Propuestas recibidas	705.2	332.7			
Plazo de vencimiento	33 d	31 d			
Tasas de interés: Mínima	1.98	1.98			
Máxima	2.00	2.00			
Promedio	2.00	2.00			
Saldo	14,886.8	15,486.8	15,486.8	14,875.8	14,875.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 30 de Noviembre del 2021	611.0	611.0	611.0	611.0	611.0
Vencimiento de CD BCRP del 22 al 26 de noviembre de 2021	611.0	611.0	611.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,613.3	4,613.3	4,613.3	4,763.3	4,763.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Enero del 2022	0.9	0.9	0.9	0.9	0.9
Vencimiento de Repo Valores del 22 al 26 de noviembre 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Reso de Cartera General del 22 al 26 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,610.6	5,610.6	5,610.6	5,894.9	5,894.9
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 13 de Enero del 2022	1.6	1.6	1.6	1.6	1.6
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 22 al 26 de noviembre 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 Reso Especial - CDR del 22 al 26 de noviembre de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	200.0	200.0	200.0	500.0	199.8
Propuestas recibidas	240.0	355.0	210.0	760.0	320.0
Plazo de vencimiento	95 d	94 d	93 d	92 d	91 d
Márgen: Mínima	0.00	0.04	0.04	0.04	0.04
Máxima	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
Promedio	0.04	0.04	0.04	0.04	0.04
Saldo	10574.9	10774.9	10974.9	10624.9	10 824.7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 23 de Noviembre del 2021	850.0	850.0	850.0	360.0	360.0
Vencimientos de CDV BCRP del 22 al 26 de noviembre de 2021	850.0	850.0	850.0	0.0	360.0
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 22 al 26 de noviembre de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 999.9 13 200.0	1 499.8 12 300.1	1 492.7 10 900.0	1 199.9 10 200.1	1 499.8 9 800.1
Propuestas recibidas	2 380.0 14 103.1	1 796.0 13 918.9	1 492.7 12 325.3	1 461.0 10 768.3	1 783.4 10 092.4
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	1.97 1.50	1.90 1.00	1.98 1.97	1.90 1.50	1.98 1.97
Máxima	2.00 1.98	2.00 1.97	2.00 1.98	2.00 1.90	2.00 1.98
Promedio	2.00 1.98	2.00 1.99	2.00 1.89	2.00 1.89	2.00 1.99
Saldo	17,200.0	17,799.9	17,892.5	18,392.5	17,492.2
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 22 de Noviembre del 2021	13,200.0	12,300.1	10,900.0	12,200.2	11,800.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 22 al 26 de noviembre de 2021	15,200.1	14,300.2	12,900.1	12,200.2	17,492.2
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	500.1	500.0			
Propuestas recibidas	1382.5	961.3			
Plazo de vencimiento	182 d	183 d			
Tasas de interés: Mínima	2.65	2.71			
Máxima	3.27	2.80			
Promedio	3.27	2.80			
Saldo	4,512.4	4,512.4	4,512.4	4,512.4	4,512.4
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 22 de Noviembre del 2021	1,045.5	1,045.5	1,045.5	1,045.5	1,045.5
Vencimiento de Coloc-TP del 22 al 26 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	1,045.5
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 22 al 26 de noviembre de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,550.0	1,550.0	1,550.0	1,550.0	1,550.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Diciembre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 22 al 26 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	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					
Vencimientos de CD BCRP del 22 al 26 de noviembre de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,972.0	1,972.0	1,972.0	1,972.0	1,972.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 30 de Noviembre del 2021	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	30.0
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					
Vencimiento de REPO del 22 al 26 de noviembre 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 Reso Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 22 al 26 de noviembre 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 Reso Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 22 al 26 de noviembre de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			200.0 200.0 200.0 120.0	200.0 200.0 50.0	80.0
Propuestas recibidas			410.0 400.0 380.0 120.0	260.0 200.0 50.0	80.0
Plazo de vencimiento			273 d 365 d 365 d 365 d	273 d 273 d 365 d	364 d
Tasas de interés: Mínima			0.59 0.55 0.40 0.57	0.51 0.57 0.59	0.55
Máxima			0.59 0.55 0.40 0.58	0.57 0.57 0.59	0.57
Promedio			0.59 0.55 0.40 0.58	0.57 0.57 0.59	0.57
Saldo	35,405.4	35,228.4	35,748.3	35,663.3	35,216.3
Próximo vencimiento de SC-Venta del 22 de Noviembre del 2021	177.0	200.1	535.0	527.0	125.0
Vencimiento de SC - Venta del 22 al 26 de noviembre de 2021	1,439.1	1,262.1	1,062.0	527.0	604.5
xx. Subasta de Bono de Valores para mercado Alternativo (BBTA)				100.0	
Propuestas recibidas				100.0	
Plazo de vencimiento				14 d	
Tasas de interés: Mínima				0.30	
Máxima				0.30	
Promedio				0.30	
Saldo	600.0	600.0	600.0	500.0	500.0
Próximo vencimiento de REO el 22 de Noviembre del 2021	200.0	300.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REO del 22 al 26 de noviembre de 2021	200.0	200.0	200.0	0.0	400.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés			100.0	100.0	
Propuestas recibidas			200.0	250.0	
Plazo de vencimiento			273 d	273 d	
Tasas de interés: Mínima			2.71	2.68	
Máxima			2.71	2.72	
Promedio			2.71	2.69	
Saldo	73,219.9	73,219.9	73,219.9	73,419.9	73,419.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 22 de Noviembre del 2021	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 22 al 26 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	900.0
b. Liquid. Repos 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	0.0	0.0	280.5	321.7	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (millones de US$)			70.0	80.0	0.0
Tipo de cambio promedio			4.0070	4.0210	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	-17.0	0.0	1,128.5	12.6
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	1,128.5	12.6
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	17.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6,284.3**	**5,681.7**	**4,832.9**	**4,647.2**	**4,504.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Contraparte temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0071%
b. Contraparte temporal directa de valores (Repo de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,530.5	3,574.3	3,051.0	2,447.8	3,258.0
Tasa de interés	1.75%	1.75%	1.75%	1.75%	1.75%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,753.8**	**2,107.4**	**1,781.9**	**2,199.4**	**1,246.9**
6. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.) (*)	124,173.3	124,120.0	124,083.5	124,038.8	123,972.8
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.8	5.5	5.4	5.3	5.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/.)	4,556.1	5,140.5	4,260.4	4,104.7	4,047.4
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.3	2.3	2.2	2.1	2.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	750.0	193.0	100.0	118.0	500.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	211.0	225.0	195.0	105.0	263.0
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 operaciones con CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	75.5	75.5	75.5	0.0
Plazo Entrada (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$)	**Nov. 12, 2021**	**Nov. 15, 2021**	**Nov. 16, 2021**	**Nov. 17, 2021**	**Nov. 18, 2021**
Tipo de cambio contable (S/. x US$)	4.0	3.9	4.0	3.9	4.0
a. Mercado spot con el público	108.6	24.1	-20.5	-80.4	33.2
i. (-) Compras	15.2	38.0	36.8	-124.1	-64.6
ii. (-) Ventas	333.1	465.8	363.3	270.2	331.6
b. Contratos forward y swap al público (con y sin entrega)	317.9	429.8	400.2	384.3	298.2
i. Pactadas	331.4	139.1	86.5	-54.4	-135.5
ii. (-) Vencidas	330.9	264.4	404.1	345.7	295.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	299.6	136.3	317.6	400.0	685.2
i. Pactadas	3.6	112.2	64.6	-31.2	-373.1
ii. (-) Vencidas	137.5	281.1	252.4	225.4	234.0
iii. Vencimientos	175.5	169.0	187.8	368.6	407.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias	373.3	187.1	286.8	427.8	262.3
i. Al contado	92.0	5.0	83.0	0.0	66.0
ii. Futuros	-168.1	24.2	-112.1	-169.7	-40.1
e. Operaciones forward asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	129.5	157.3	198.7	258.4	208.3
i. Compras	294.0	133.1	298.7	386.3	646.5
ii. (-) Ventas	0.0	-20.4	0.2	0.1	1.0
f. Efecto de Opciones	2.3	-26.2	-49.9	195.0	48.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras					
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0249	4.0014	3.9996	4.0047	4.0199

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera