BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	29 Nov 21			30 Nov 21			1 Dic 21			2 Dic 21			3 Dic 21		
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**13,685.3**			**15,537.8**			**14,298.3**			**14,846.8**			**15,809.1**		
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones															
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR															
i. Subasta de Compra Temporal de Depósitos del BCRP (CD BCR)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo	14,875.8			14,662.8			14,662.8			14,662.8			14,662.8		
Próximo vencimiento de CD BCRP el 17 de Diciembre del 2021	213.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
Vencimiento de CD BCRP del 6 al 10 de Diciembre 2021	213.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo	4,913.3			4,913.3			4,913.3			5,063.3			5,263.3		
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 3 de Enero del 2022	0.9			0.9			0.9			0.9			200.0		
Vencimiento de Reso Valores del 6 al 10 de Diciembre 2021	0.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
iii. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (General)															
Posturas 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 6 al 10 de Diciembre 2021	0.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo	6,172.7			6,172.7			6,172.7			6,452.7			6,451.5		
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 6 al 10 de Diciembre 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															
Posturas 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															
Posturas 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)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de REPO Especial - CDR															
Vencimiento de Reso Especial - CDR del 6 al 10 de Diciembre 2021															
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	200.0			999.8			500.0			200.0					
Posturas recibidas	270.0			1425.0			650.0			200.0					
Plazo de vencimiento	88 d			87 d			98 d			95 d					
Mínimo: Mínima	0.04			0.04			0.04			0.04					
Máxima	0.04			0.04			0.04			0.04					
Promedio	0.04			0.04			0.04			0.04					
Saldo	11,374.7			10,374.5			10,874.5			11,074.5			11,074.5		
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 13 de Diciembre del 2021	2000.0			2399.9			2398.9			2399.9			2,399.9		
Vencimientos de CDV BCRP del 6 al 10 de Diciembre 2021	2000.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (COLD BCRP)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de COLD BCRP															
Vencimiento de COLD BCRP del 6 al 10 de Diciembre 2021															
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 077.4	7 256.0		927.0	9 584.5		933.1	5 719.0		7 200.1			8 300.0		
Posturas recibidas	1 077.4	7 256.0		927.0	9 584.5		933.1	5 719.0		7 875.8			8 619.4		
Plazo de vencimiento	7 d	1 d		7 d	1 d		8 d	1 d		1 d			3 d		
Tasas de interés: Mínima	1.98	1.98		1.98	1.99		1.98	1.98		1.98			1.98		
Máxima	2.00	1.98		2.00	1.99		2.00	1.98		1.99			1.99		
Promedio	2.00	1.98		2.00	1.99		2.00	1.98		1.99			1.99		
Saldo	14,322.5			16,077.9			11,645.9			11,627.0			11,237.5		
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 6 de Diciembre del 2021	6,758.1			11,084.1			7,219.0			8,689.5			9,377.4		
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 6 al 10 de Diciembre 2021	13,245.1			14,073.5			8,708.4			8,689.5			11,237.5		
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	500.1														
Posturas recibidas	888.0														
Plazo de vencimiento	91 d														
Tasas de interés: Mínima	2.41														
Máxima	2.46														
Promedio	2.46														
Saldo	4,467.0			4,467.0			4,467.0			4,467.0			4,467.0		
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 6 de Diciembre del 2021	466.8			466.8			466.8			466.8			466.8		
Vencimiento de Coloc-TP del 6 al 10 de Diciembre 2021	0.0			0.0			0.0			0.0			466.8		
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de Coloc-BN															
Vencimiento de Coloc - BN del 6 al 10 de Diciembre 2021															
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	200.0	200.0													
Posturas recibidas	200.0	200.0													
Plazo de vencimiento	91 d	91 d													
Tasas de interés: Mínima	0.58	0.59													
Máxima	0.60	0.60													
Promedio	0.59	0.59													
Saldo	1,950.0			1,950.0			1,950.0			1,950.0			1,950.0		
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 6 al 10 de Diciembre 2021	0.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
xiv. Subasta de Certificados de Depósitos del BCR con Negociación Restringida (CDBCRP-NR)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de CDBCRP-NR															
Vencimientos de CD BCRP del 6 al 10 de Diciembre 2021															
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)													100.0		
Posturas recibidas													325.0		
Plazo de vencimiento													31 d		
Tasas de interés: Mínima													2.90		
Máxima													3.10		
Promedio													3.00		
Saldo	1,942.0			1,942.0			1,942.0			1,942.0			2,042.0		
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Enero del 2022	30.0			30.0			30.0			30.0			100.0		
Vencimiento REPO del 6 al 10 de Diciembre 2021	0.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de Reso															
Vencimiento de REPO del 6 al 10 de Diciembre 2021															
xvii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de Reso Expansión															
Vencimiento de REPO Expansión del 6 al 10 de Diciembre 2021															
xviii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)															
Posturas recibidas															
Plazo de vencimiento															
Tasas de interés: Mínima															
Máxima															
Promedio															
Saldo															
Próximo vencimiento de Reso Sustitución															
Vencimiento de REPO Sustitución del 6 al 10 de Diciembre 2021															
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0	200.1	200.0	190.0	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0	180.0	200.0	200.0	300.0
Posturas recibidas	710.0	710.0	411.0	590.0	430.0	267.0	450.0	190.0	504.0	305.0	375.0	280.0	240.0	440.0	300.0	180.0	250.0	575.0	540.0
Plazo de vencimiento	183 d	189 d	279 d	365 d	365 d	365 d	365 d	274 d	365 d	365 d	365 d	365 d	365 d	365 d	368 d	367 d	367 d	367 d	367 d
Tasas de interés: Mínima	0.37	0.33	0.42	0.35	0.37	0.52	0.48	0.52	0.30	0.50	0.45	0.50	0.44	0.48	0.48	0.53	0.58	0.50	0.49
Máxima	0.38	0.34	0.50	0.37	0.42	0.56	0.50	0.54	0.30	0.54	0.54	0.55	0.47	0.49	0.55	0.56	0.59	0.51	0.50
Promedio	0.38	0.34	0.50	0.36	0.42	0.56	0.50	0.54	0.30	0.54	0.49	0.55	0.47	0.49	0.53	0.56	0.59	0.51	0.50
Saldo	36,715.8			37,315.9			37,717.4			38,167.4			38,390.5		
Próximo vencimiento de SC-Venta del 6 de Diciembre del 2021	388.5			388.5			350.0			956.9			1,050.0		
Vencimiento de SC - Venta del 6 al 10 de Diciembre 2021	1,695.4			1,695.4			1,306.9			956.9			1,459.5		
xx. Subasta de Repo de Valores para remesas dólares (SBTR)										80.0					
Posturas recibidas										80.0					
Plazo de vencimiento										14 d					
Tasas de interés: Mínima										0.30					
Máxima										0.30					
Promedio										0.30					
Saldo	400.0			400.0			400.0			380.0			380.0		
Próximo vencimiento de RED el 7 de Diciembre del 2021	100.0			100.0			100.0			150.0			150.0		
Vencimiento de RED del 6 al 10 de Diciembre 2021	100.0			100.0			100.0			0.0			300.0		
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0			50.0									50.0		
Posturas recibidas	50.0			150.0									150.0		
Plazo de vencimiento	91 d			181 d									274 d		
Tasas de interés: Mínima	2.25			2.55									2.83		
Máxima	2.25			2.55									2.83		
Promedio	2.25			2.55									2.83		
Saldo	22,769.9			22,469.9			22,769.9			22,969.9			21,969.9		
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 6 de Diciembre del 2021	200.0			200.0			200.0			200.0			200.0		
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 6 al 10 de Diciembre 2021	800.0			600.0			400.0			200.0			600.0		
b. Liquidez. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)															
c. Operaciones Forward en el Mercado de la Mesa de Negociación del BCR	487.1			65.2			118.1			309.5			652.3		
i. Compras (millones de US$)	n.o.			n.o.			n.o.			n.o.			n.o.		
Tipo de cambio promedio	0.0000			0.0000			0.0000			0.0000			0.0000		
ii. Ventas (millones de US$)	120.0			16.0			29.0			76.0			180.0		
Tipo de cambio promedio	4.0595			4.0720			4.0720			4.0729			4.0770		
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	1.0			-8.2			-28.6			2.0			-2.7		
i. Compras (millones de US$)	1.0			1.8			1.4			2.0			5.3		
ii. Ventas (millones de US$)				10.0			30.0			0.0			8.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR															
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,764.9**			**3,961.3**			**7,026.1**			**7,136.2**			**7,356.8**		
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones															
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)															
Contratos (tasa efectiva diaria)	0.0062%			0.0062%			0.0062%			0.0062%			0.0070%		
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0			0.0			0.0			0.0			0.0		
Tasa de interés	3.40%			3.40%			3.40%			3.40%			3.40%		
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional															
Tasa de interés															
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	4,157.0			2,865.3			976.2			876.1			1,141.0		
Tasa de interés	3.25%			3.25%			3.25%			3.25%			3.25%		
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**607.0**			**1,096.0**			**6,049.9**			**6,260.1**			**6,215.8**		
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12,273.8			12,273.8			12,273.8			12,267.8			12,267.8		
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.2			4.2			4.2			4.2			4.2		
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,916.3			2,835.9			2,795.5			6,049.9			6,190.1		
d. Cuenta corriente moneda nacional acumulado (% del TOSE) (*)	1.0			1.0			1.0			2.1			2.2		
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP															
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	120.0			31.0			506.0			644.5			705.0		
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	2.00 / 2.00 / 2.00			2.00 / 2.00 / 2.00			2.00 / 2.00 / 2.00			2.00 / 2.00 / 2.00			2.00 / 2.00 / 2.00		
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	201.0			183.0			67.0			150.0			190.0		
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 CTVC	n.o.			n.o.			n.o.			n.o.			n.o.		
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$)	**Nov 26, 2021**			**Nov 29, 2021**			**Nov 30, 2021**			**Dic 01, 2021**			**Dic 02, 2021**		
Saldo de la posición global	1,179.3			1,177.6			1,156.7			1,164.9			1,164.9		
Pasivo de cuentas contables	21.8			115.6			-130.9			-43.3			45.3		
a. Mercado spot con el público	33.1			-87.6			-130.7			-42.5			-26.0		
Compras	320.2			294.1			287.9			231.9			275.6		
ii. (-) Ventas	287.1			381.7			418.6			274.4			304.6		
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-61.6			-179.0			-56.5			-108.5			-198.7		
i. Pactadas	158.3			170.2			312.8			72.3			183.0		
ii. (-) Vencidas	249.9			295.1			369.1			180.8			351.2		
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-47.6			21.2			90.9			-64.7			-24.9		
i. Pactadas	260.2			745.3			328.8			192.5			387.9		
ii. (-) Vencidas	307.8			724.1			238.0			257.1			412.8		
d. Operaciones cambiarias interbancarias															
i. Al contado	512.0			276.9			337.5			246.0			248.7		
ii. Futuros	75.0			0.0			140.0			0.0			10.0		
e. Operaciones con asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	42.1			425.2			-146.6			26.6			61.1		
i. Compras	290.0			698.9			217.1			306.6			419.9		
ii. (-) Ventas	247.9			274.1			363.6			179.3			349.8		
f. Efecto de Opciones	-0.2			-0.3			0.7			-0.3			0.8		
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	39.0			364.8			162.9			116.8			225.8		
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera															
Tasa de interés															
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0386			4.0567			4.0545			4.0680			4.0731		
(*) Datos preliminares															

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera