# BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

## RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

| | 31 Ago 21 | 1 Set 21 | 2 Set 21 | 3 Set 21 |
|---|---|---|---|---|
| **1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP** | **21,476.4** | **21,033.9** | **22,625.8** | **23,292.1** |
| **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) | | 19.0 | 2.0 27.0 | 37.5 |
| Propuestas recibidas | | 29.0 | 2.0 67.0 | 37.5 |
| Plazo de vencimiento | | 90 d | 29 d 89 d | 28 d |
| Tasas de interés: Mínima | | 0.58 | 0.50 0.52 | 0.50 |
| Máxima | | 0.65 | 0.50 0.70 | 0.50 |
| Promedio | | 0.63 | 0.50 0.66 | 0.50 |
| Saldo | 33.013.7 | 33.102.7 | 31.470.8 | 30.585.3 |
| Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de Setiembre del 2021 | 1.807.9 | 1.807.9 | 1.013.0 | 1.845.0 |
| Vencimiento de CD BCRP del 06 al 10 de setiembre 2021 | 2.820.9 | 2.820.9 | 1.013.0 | 3.245.0 |
| ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 7.725.4 | 7.725.4 | 7.825.4 | 7.765.4 |
| Próximo vencimiento de Repo de Valores el 13 de Setiembre del 2021 | 60.0 | 60.0 | 60.0 | 1.500.0 |
| Vencimiento de Repo Valores del 06 al 10 de setiembre 2021 | 60.0 | 60.0 | 60.0 | 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 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera General | | | 0.0 | |
| Vencimiento de Repo de Cartera General del 06 al 10 de setiembre 2021 | | | 0.0 | |
| iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo) | | | | |
| Propuestas recibidas | | | | |
| Plazo de vencimiento | | | | |
| Tasas de interés: Mínima | | | | |
| Máxima | | | | |
| Promedio | | | | |
| Saldo | 2.885.7 | 2.885.7 | 2.885.7 | 2.885.7 |
| Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 13 de Setiembre del 2021 | 2.5 | 2.5 | 2.5 | 2.5 |
| Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 06 al 10 de setiembre 2021 | 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 |
| 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 |
| 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 06 al 10 de setiembre 2021 | | | | |
| viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP) | 300.0 | 200.0 | 300.0 | 300.0 |
| Propuestas recibidas | 330.0 | 305.0 | 480.0 | 530.0 |
| Plazo de vencimiento | 91 d | 90 d | 89 d | 88 d |
| Margen: Mínima | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Máxima | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Promedio | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Saldo | 1450.0 | 1650.0 | 1950.0 | 2250.0 |
| Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de noviembre de 2021 | 850.0 | 850.0 | 850.0 | 850.0 |
| Vencimientos de CDV BCRP del 06 al 10 de setiembre 2021 | 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 06 al 10 de setiembre 2021 | | | | |
| x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP) | 1.500.2 14.172.4 | 2.000.1 12.000.0 | 2.500.1 13.215.8 | 2.500.0 13.802.0 |
| Propuestas recibidas | 1.896.0 14.172.4 | 2.181.1 12.065.0 | 2.579.8 13.215.8 | 3.099.6 13.802.0 |
| Plazo de vencimiento | 7 d 1 d | 7 d 1 d | 7 d 1 d | 7 d 3 d |
| Tasas de interés: Mínima | 0.49 0.42 | 0.49 0.42 | 0.49 0.48 | 0.49 0.48 |
| Máxima | 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 0.50 |
| Saldo | 21.172.8 | 20.000.6 | 21.216.3 | 22.302.4 |
| Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 6 de Setiembre del 2021 | 16.172.3 | 14.500.2 | 15.215.9 | 13.802.0 |
| Vencimiento de Depósitos a Plazo del 06 al 10 de setiembre 2021 | 20.672.6 | 16.500.3 | 15.215.9 | 22.302.4 |
| 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 |
| Próximo vencimiento de Coloc-TP el 17 de Setiembre del 2021 | 152.2 | 152.2 | 152.2 | 152.2 |
| Vencimiento de Coloc-TP del 06 al 10 de setiembre 2021 | 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 06 al 10 de setiembre 2021 | | | | |
| xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP) | 41.0 195.0 | 200.0 150.0 | | |
| Propuestas recibidas | 41.0 195.0 | 230.0 150.0 | | |
| Plazo de vencimiento | 63 d 63 d | 62 d 63 d | | |
| Tasas de interés: Mínima | 0.59 0.60 | 0.60 0.60 | | |
| Máxima | 0.59 0.60 | 0.60 0.60 | | |
| Promedio | 0.59 0.60 | 0.60 0.60 | | |
| Saldo | 6.372.0 | 6.722.0 | 6.722.0 | 6.222.0 |
| Próximo vencimiento de CDR BCRP el 7 de Setiembre del 2021 | 500.0 | 500.0 | 500.0 | 660.0 |
| Vencimiento de CDR BCRP del 06 al 10 de setiembre 2021 | 500.0 | 500.0 | 500.0 | 711.0 |
| 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 06 al 10 de setiembre 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 |
| Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Setiembre del 2021 | 30.0 | 30.0 | 30.0 | 30.0 |
| Vencimiento de REPO del 06 al 10 de setiembre 2021 | 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 06 al 10 de setiembre 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 06 al 10 de setiembre 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 06 al 10 de setiembre 2021 | | | | |
| xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP | | 110.0 90.0 | 200.0 200.0 10.0 | 200.0 200.0 200.0 200.0 |
| Propuestas recibidas | | 210.0 90.0 | 238.0 226.0 10.0 | 205.0 215.0 389.0 315.0 |
| Plazo de vencimiento | | 62 d 63 d | 62 d 62 d 62 d | 62 d 62 d 62 d 63 d |
| Tasas de interés: Mínima | | 0.60 0.56 | 0.60 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 0.60 0.60 0.60 |
| Promedio | | 0.60 0.59 | 0.60 0.60 0.60 | 0.60 0.60 0.60 0.60 |
| Saldo | 26.429.9 | 26.250.4 | 25.910.2 | 26.710.2 |
| Próximo vencimiento de SC-Venta el 8 de Setiembre del 2021 | 379.5 | 750.2 | 180.5 | 180.5 |
| Vencimiento de SC - Venta del 06 al 10 de setiembre 2021 | 1.129.7 | 750.2 | 0.0 | 512.0 |
| xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED) | 183.0 | 183.0 | 300.0 | |
| Propuestas recibidas | 183.0 | 183.0 | 326.0 | |
| Plazo de vencimiento | 14 d | 14 d | 14 d | |
| Tasas de interés: Mínima | 0.30 | 0.30 | 0.30 | |
| Máxima | 0.30 | 0.30 | 0.40 | |
| Promedio | 0.30 | 0.30 | 0.35 | |
| Saldo | 600.0 | 600.0 | 900.0 | 900.0 |
| Próximo vencimiento de RED el 6 de Setiembre del 2021 | 165.0 | 165.0 | 165.0 | 165.0 |
| Vencimiento de RED del 06 al 10 de setiembre 2021 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 417.0 |
| xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés | 200.0 500.0 200.0 | 200.0 300.0 200.0 | 200.0 300.0 200.0 | 200.0 300.0 200.0 |
| Propuestas recibidas | 500.0 1.600.0 700.0 | 600.0 1150.0 850.0 | 700.0 1150.0 600.0 | 830.0 1200.0 800.0 |
| 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 |
| Tasas de interés: Mínima | 075 0.90 1.02 | 0.78 0.98 1.13 | 0.78 1.08 1.15 | 0.85 1.20 1.27 |
| Máxima | 075 0.90 1.03 | 0.78 0.98 1.13 | 0.78 1.20 1.22 | 0.85 1.25 1.28 |
| Promedio | 075 0.90 1.03 | 0.78 0.98 1.13 | 0.78 1.15 1.18 | 0.85 1.22 1.27 |
| Saldo | 3.449.9 | 4.149.9 | 4.849.9 | 5.549.9 |
| Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 23 de Noviembre del 2021 | 100.0 | 100.0 | 100.0 | 100.0 |
| Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 06 al 10 de setiembre 2021 | 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 | 40.9 | 0.0 | 168.1 | 0.0 |
| i. Compras (millones de US$) | | | | |
| Tipo de cambio promedio | | | | |
| ii. Ventas (millones de US$) | 10.0 | 0.0 | 41.0 | 0.0 |
| Tipo de cambio promedio | 4.0898 | 0.0000 | 4.1005 | |
| d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| i. Compras (millones de US$) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| ii. Ventas (millones de US$) | | | | |
| e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR | | | | |
| ii. Compras de BTP (Valorizado) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| **3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones** | **5.226.9** | **6.464.8** | **6.412.8** | **6.652.6** |
| **4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones** | | | | |
| a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps) | | | | |
| Comisión (tasa efectiva diaria) | 0.0037% | 0.0037% | 0.0037% | 0.0029% |
| b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta) | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Tasa de interés | 1.00% | 1.00% | 1.00% | 1.00% |
| c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| d. Depósitos Overnight en moneda nacional | 4.064.7 | 1.827.9 | 952.9 | 1.441.3 |
| Tasa de interés | 0.35% | 0.35% | 0.35% | 0.35% |
| **5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones** | **1.162.2** | **4.636.9** | **5.459.9** | **5.211.3** |
| a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*) | 8.450.4 | 8.382.2 | 11.214.0 | 11.625.7 |
| b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 4.1 | 4.1 | 5.5 | 5.7 |
| c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) | 2.289.1 | 2.218.6 | 4.636.9 | 5.185.5 |
| d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*) | 1.1 | 1.1 | 2.3 | 2.5 |
| **6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP** | | | | |
| a. Operaciones a la vista en moneda nacional | 540.0 | 420.0 | 590.0 | 420.0 |
| Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO | 0.50 / 0.50 / 0.50 | 0.50 / 0.50 / 0.50 | 0.50 / 0.50 / 0.50 | 0.50 / 0.50 / 0.50 |
| b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$) | 20.0 | 0.0 | 119.0 | 121.0 |
| 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 |
| c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 10.2 |
| 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 27, 2021** | **Ago 31, 2021** | **Set 01, 2021** | **Set 02, 2021** |
| Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g | -19.5 | -75.0 | 75.0 | 34.0 |
| Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g | -18.3 | -217.2 | 242.0 | -9.4 |
| a. Mercado spot con el público | -13.0 | -36.4 | 158.8 | 1.7 |
| i. Compras | 538.8 | 616.7 | 458.8 | 335.1 |
| ii. (-) Ventas | 551.8 | 653.1 | 300.0 | 333.4 |
| b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega) | -99.1 | -71.1 | -109.9 | -51.0 |
| i. Pactadas | 141.4 | 340.6 | 265.3 | 410.7 |
| ii. (-) Vencidas | 240.5 | 411.7 | 375.2 | 461.7 |
| c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega) | -16.0 | -213.4 | 2.5 | -199.2 |
| i. Pactadas | 218.4 | 173.0 | 254.6 | 372.9 |
| ii. (-) Vencidas | 234.4 | 386.4 | 252.1 | 572.1 |
| d. Operaciones cambiarias interbancarias | | | | |
| i. Al contado | 488.3 | 543.4 | 287.9 | 460.1 |
| ii. A futuro | 46.0 | 55.0 | 36.0 | 50.0 |
| e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega | -22.9 | -83.4 | -121.5 | 58.8 |
| i. Compras | 212.3 | 323.8 | 215.1 | 519.1 |
| ii. (-) Ventas | 235.2 | 407.2 | 336.6 | 460.3 |
| f. Efecto de Opciones | -1.6 | -0.2 | 0.2 | -0.2 |
| g. Operaciones netas con otras instituciones financieras | 95.0 | -122.7 | 26.8 | -64.2 |
| h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera | | | | |
| Tasa de interés | | | | |
| Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec) | 4.0736 | 4.0865 | 4.0785 | 4.0988 |
| (*) Datos preliminares | | | | |

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera