BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	20 Set 21		21 Set 21		22 Set 21		23 Set 21		24 Set 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**19,836.3**		**18,705.8**		**17,591.1**		**17,378.1**		**16,960.3**	
2. Operaciones monetarias anunciadas del BCR										
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR										
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)									73.0	
Propuestas recibidas									203.0	
Plazo de vencimiento									31 d	
Tasas de interés: Mínima									01.0	
Máxima									01.0	
Promedio									01.0	
Saldo	23,870.1		23,870.1		23,870.1		23,870.1		22,161.5	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 27 de Setiembre del 2021	1,881.6		1,881.6		1,881.6		1,881.6		2,035.5	
Vencimiento de CD BCRP del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021	1,881.6		1,881.6		1,881.6		1,881.6		2,354.5	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	6,101.3		6,101.3		6,066.3		6,067.5		5,667.5	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Setiembre del 2021	35.0		35.0		400.0		400.0		77.0	
Vencimiento de Repo Valores del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021	495.0		495.0		400.0		400.0		177.0	
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 27 de setiembre al 01 de Octubre, 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	3,362.1		3,361.2		3,485.2		3,535.2		3,546.8	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 15 de Octubre del 2021	0.3		0.3		0.3		0.3		0.3	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 27 de setiembre al 01 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 (Resulta)										
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 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021										
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	100.0	200.0	130.0		100.0		300.0		300.0	
Propuestas recibidas	100.0	400.0	760.0		700.0		540.0		700.0	
Plazo de vencimiento	35 d	91 d	90 d		89 d		88 d		95 d	
Mínima: Mínima	0.00	0.00	0.00		0.00		0.00		0.00	
Máxima	0.00	0.00	0.04		0.00		0.04		0.00	
Promedio	0.00	0.00	0.01		0.00		0.01		0.00	
Saldo	7544.9		7174.9		7374.9		7674.9		7874.9	
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 27 de setiembre al 01 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 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 904.0	12 690.1	1 845.2	12 899.8	1 690.4	10 904.1	1 261.9	11 960.7	1 500.2	13 416.8
Propuestas recibidas	1 904.0	12 690.1	1 845.2	13 061.6	1 690.4	10 904.1	1 261.9	11 960.7	1 658.0	13 416.8
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	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap	n.ap
Máxima	1.00	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	1.00
Saldo	22,128.8		22,087.2		20,098.9		20,559.2		21,618.5	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Setiembre del 2021	14,786.6		14,562.8		12,762.3		13,857.7		15,326.8	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021	26,234.8		18,738.0		14,648.3		13,857.7		21,618.5	
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 27 de setiembre al 01 de Octubre, 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 Coloc-BN										
Vencimiento de Coloc - BN del 27 de setiembre al 01 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	5,196.0		4,956.0		4,956.0		4,856.0		4,856.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 27 de Setiembre del 2021	150.0		120.0		120.0		570.0		570.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021	270.0		120.0		120.0		0.0		1,340.0	
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 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021										
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resulta)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	1,872.0		1,872.0		1,872.0		1,872.0		1,872.0	
Próximo vencimiento de Repo Dólar el 27 de Setiembre del 2021	30.0		30.0		30.0		30.0		30.0	
Vencimiento de REPO del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 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 Repo										
Vencimiento de REPO del 27 de setiembre al 01 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 Repo Expansión										
Vencimiento de REPO Expansión del 27 de setiembre al 01 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 Repo Sustitución										
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	10.0		200.0	140.0	200.0		100.0	200.0 185.0	200.0	200.0 200.0
Propuestas recibidas	210.0		200.0	140.0	200.0		100.0	250.0 185.0	200.0	590.0 560.0
Plazo de vencimiento	60 d		181 d	181 d	91 d		181 d	273 d 273 d	90 d	273 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	0.60		0.60	0.60	0.58		0.60	0.55 0.58	0.60	0.55 0.55
Máxima	0.60		0.60	0.60	0.59		0.60	0.55 0.60	0.60	0.55 0.55
Promedio	0.60		0.60	0.60	0.59		0.60	0.54 0.59	0.60	0.54 0.55
Saldo	25,159.1		25,159.1		25,359.1			25,756.1		26,196.1
Próximo vencimiento de SC- Venta el 1 de Octubre del 2021	340.0		78.0		78.0			200.0		40.0
Vencimiento de SC - Venta del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021	618.0		278.0		278.0			200.0		40.0
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	595.0		595.0		595.0			795.0		595.0
Próximo vencimiento de REDI el 28 de Setiembre del 2021	200.0		200.0		200.0			200.0		200.0
Vencimiento de REDI del 27 de setiembre al 01 de Octubre, 2021	200.0		200.0		200.0			200.0		395.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	400.0	200.0	400.0	200.0	200.0	400.0	200.0	400.0 200.0	200.0	400.0 200.0
Propuestas recibidas	1400.0	600.0	800.0	540.0	600.0	1200.0	400.0	1000.0 600.0	700.0	1000.0 600.0
Plazo de vencimiento	181 d	273 d	181 d	273 d	91 d	181 d	91 d	181 d 273 d	91 d	181 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	1.65	1.75	1.66	1.82	1.28	1.62	1.25	1.58 1.80	1.25	1.63 1.85
Máxima	1.66	1.80	1.72	1.82	1.28	1.62	1.25	1.66 1.83	1.25	1.63 1.86
Promedio	1.66	1.79	1.69	1.82	1.28	1.62	1.25	1.61 1.82	1.25	1.63 1.86
Saldo	11,249.9		11,849.9		12,449.9			13,249.9		14,049.9
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 27 de setiembre al 01 de Octubre, 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 Interbancarias con Tasas de Negociación del BCR	947.3		205.8		12.3			226.2		386.3
i. Contratos (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)	230.0		50.0		3.0			55.0		94.0
Tipo de cambio promedio	4.1188		4.1160		4.1130			4.1125		4.1100
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	-31.0		700.1		350.0			0.0		350.4
i. Compras (millones de US$)			700.1		350.0			0.0		350.4
ii. Ventas (millones de US$)	31.0									
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR e BTP	0.0		0.0		0.0			0.0		0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Vencimiento)	0.0		0.0		0.0			0.0		0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,825.9**		**3,094.9**		**4,534.3**			**3,828.3**		**2,933.6**
4. Operaciones monetarias del BCR tras el cierre de operaciones										
a. Compra temporal directa de valores (subasta)										
Contratos (tasa efectiva diaria)	0.0037%		0.0037%		0.0037%			0.0037%		0.0045%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0		0.0		0.0			0.0		0.0
Tasa de interés	n.ap.		n.ap.		n.ap.			n.ap.		n.ap.
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,298.5		1,663.8		2,805.5			2,326.2		2,177.8
Tasa de interés	0.85%		0.85%		0.85%			0.85%		0.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,527.4**		**1,341.1**		**1,728.8**			**1,501.1**		**755.8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,448.1		9,353.0		9,281.7			9,729.0		9,153.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado requerido (millones de S/) (*)	8,448.1		8,353.0		8,281.7			8,229.0		8,153.3
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,027.6		2,958.0		2,876.1			2,843.0		2,761.1
d. Coeficiente de encaje en moneda nacional promedio acumulado (veces) (*)	1.5		1.5		1.4			1.4		1.4
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CRBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0		0.0		415.0			120.0		130.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.00 / 1.00 / 1.00		1.00 / 1.00 / 1.00		1.00 / 1.00 / 1.00			1.00 / 1.00 / 1.00		1.00 / 1.00 / 1.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	155.0		142.0		0.0			0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25		0.25 / 0.25 / 0.25							
c. Total mercado secundario de CRBCRP, CRBCRP-NR y CDV	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 Interbancarias con Derivados Financieros bancarios (millones de US$)	**Set 17, 2021**		**Set 20, 2021**		**Set 21, 2021**			**Set 22, 2021**		**Set 23, 2021**
Saldo de la posición global: a = b + c + d + e	-254.7		79.9		-26.8			-8.9		64.4
Flujo de la posición cambiar: = a + b.ii - c.ii + d + e	14.7		292.7		-46.8			-205.0		-46.1
a. Mercado spot con el público	-29.1		60.7		-61.0			-212.8		-76.7
i. Compras	349.2		333.8		319.4			322.9		284.3
ii. (-) Ventas	378.3		273.1		380.4			535.7		361.0
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	414.9		198.6		468.6			474.4		413.9
i. Pactadas	156.8		191.4		427.1			218.2		565.3
ii. (-) Vencidas	92.0		82.8		258.5			164.8		504.0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	133.3		247.2		151.4			-93.2		18.0
i. Pactadas	177.8		308.5		302.4			199.2		403.1
ii. (-) Vencidas	44.6		61.3		150.9			292.4		385.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Activo	418.1		350.3		321.3			396.6		451.8
ii. (-) Pasivo	0.0		40.0		5.0			410.8		130.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-48.3		-1.0		-101.2			140.6		-108.1
i. Compras	36.7		56.6		147.4			365.9		373.3
ii. (-) Ventas	85.0		57.6		248.6			143.4		481.3
f. Efecto de Opciones	0.0		22.1		0.0			0.0		-1.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	44.6		38.3		7.9			43.5		118.2
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.1087		4.1190		4.1128			4.1102		4.1116

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera