BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	04 Oct 21	05 Oct 21	06 Oct 21	07 Oct 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**19,251.8**	**20,688.5**	**22,548.2**	**24,057.0**
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				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	19,807.0	19,807.0	19,807.0	18,532.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Octubre del 2021	1,274.9	1,274.9	1,274.9	2,026.1
Vencimiento de CD BCRP del 11 al 15 de Octubre. 2021	1,274.9	1,274.9	1,274.9	2,026.1
ii. Subasta de Cartera Temporal de Valores /REPO/				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4,548.1	4,548.1	4,548.1	4,548.1
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 11 de Octubre del 2021	45.0	45.0	45.0	45.0
Vencimiento de Repo Valores del 11 al 15 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	774.0
iii. Subasta de Cartera Temporal de Carteras 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	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 11 al 15 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Cartera Temporal de Carteras de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	4,524.8	4,524.8	4,524.8	4,579.2
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 15 de Octubre del 2021	0.3	0.3	0.3	0.3
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 11 al 15 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	0.0
v. Subasta de Cartera Temporal de Carteras de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Resudar)				
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 Cartera Temporal de Carteras de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Esencial)				
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 Cartera Temporal de Valores /REPO Esencial - CDR/				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de REPO Esencial - CDR				
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 11 al 15 de Octubre. 2021				
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR /CDV BCRP/		300.0	180.0	70.0
Propuestas recibidas		930.0	780.0	130.0
Plazo de vencimiento		84 d	83 d	36 d
Mínimo: Mínima		0.00	0.03	0.00
Máxima		0.00	0.04	0.00
Promedio		0.00	0.03	0.00
Saldo	8954.9	8954.9	8954.9	8954.9
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 25 de Octubre del 2021	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimientos de CDV BCRP del 11 al 15 de Octubre. 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 11 al 15 de Octubre. 2021				
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional /DP BCRP/	10,899.9	12,800.1	14,200.0	16,399.6
Propuestas recibidas	12,596.0	14,556.5	16,808.4	18,954.7
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	4 d	4 d
Tasas de interés: Mínima	n.op	n.op	n.op	n.op
Máxima	1.00	1.00	1.00	1.00
Promedio	1.00	1.00	1.00	1.00
Saldo	16,145.7	16,045.9	15,688.4	16,399.6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Octubre del 2021	12,899.9	14,557.5	15,688.4	16,399.6
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 11 al 15 de Octubre. 2021	16,145.7	16,045.9	15,688.4	0.0
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
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 8 de Noviembre del 2021	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 11 al 15 de Octubre. 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 11 al 15 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	3,736.0	3,736.0	3,736.0	3,736.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 12 de Octubre del 2021	790.0	790.0	790.0	790.0
Vencimiento de CDR BCRP del 11 al 15 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	1,430.0
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 11 al 15 de Octubre. 2021				
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Resudar)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1,842.0	1,842.0	1,842.0	1,842.0
Próximo vencimiento de Repo Dólares el 15 de Octubre del 2021	40.0	40.0	40.0	40.0
Vencimiento de REPO del 11 al 15 de Octubre. 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 Reso				
Vencimiento de REPO del 11 al 15 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 Reso Expansion				
Vencimiento de REPO Expansión del 11 al 15 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 Reso Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución del 11 al 15 de Octubre. 2021				
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 200.0	200.0 200.0 200.0 163.0	100.0 200.0 200.0	
Propuestas recibidas	200.0 375.0	200.0 350.0 520.0 163.0	100.0 370.0 200.0	
Plazo de vencimiento	92 d 182 d	182 d 273 d 92 d 273 d	273 d 273 d 273 d	
Tasas de interés: Mínima	0.52 0.49	0.52 0.52 0.49 0.55	0.58 0.52 0.50	
Máxima	0.53 0.56	0.55 0.54 0.52 0.59	0.60 0.56 0.60	
Promedio	0.53 0.52	0.54 0.53 0.50 0.57	0.59 0.52 0.51	
Saldo	30,546.2	12,307.2	31,807.2	31,807.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 12 de Octubre del 2021	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de SC - Venta del 11 al 15 de Octubre. 2021	0.0	0.0	0.0	255.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)	200.0			
Propuestas recibidas	204.0			
Plazo de vencimiento	14 d			
Tasas de interés: Mínima	0.30			
Máxima	0.38			
Promedio	0.30			
Saldo	600.0	600.0	600.0	400.0
Próximo vencimiento de RED el 12 de Octubre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de RED del 11 al 15 de Octubre. 2021	200.0	200.0	200.0	200.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0 400.0 300.0	100.0 400.0 300.0		
Propuestas recibidas	400.0 1300.0 1000.0	500.0 1400.0 1150.0		
Plazo de vencimiento	92 d 182 d 273 d	92 d 182 d 273 d		
Tasas de interés: Mínima	1.40 1.87 2.15	1.40 1.85 2.10		
Máxima	1.40 2.02 2.21	1.40 1.88 2.20		
Promedio	1.40 1.92 2.16	1.40 1.87 2.17		
Saldo	18,649.9	19,649.9	19,649.9	19,649.9
Próximo vencimiento de Swaps 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 11 al 15 de Octubre. 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	694.1	0.0	632.8	0.0
i. Compras (millones de US$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US$)	168.0		153.0	
Tipo de cambio promedio	4.1316		4.1357	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	1.1	0.0	65.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	1.1	0.0	0.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)			65.0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP + CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP Negociable	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7,656.7**	**7,588.4**	**7,555.4**	**7,597.4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de valores (Repo de valores)				
Comisión / tasa efectiva diaria	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0040%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	2.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	954.2	883.0	1,005.2	2,145.5
Tasa de interés	0.65%	0.65%	0.80%	1.30%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**6,702.5**	**6,705.4**	**6,550.2**	**5,451.9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12,341.3	12,547.3	12,529.2	12,514.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado 7k del TOSEL (*)	7,000.0	7,000.0	7,000.0	7,000.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6,184.8	6,342.1	6,445.6	6,432.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado 7k del TOSEL (*)	3.1	3.2	3.2	3.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de FTMN				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	525.0	340.0	125.0	130.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	88.0	91.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máximal Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25		
c. Total mercado secundario de FTMN* (FTMN*BB, FTMN*BB-NR y FTMN	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 cambiarias interbancarias y mesa de negociación (millones de US$)	**Oct 01, 2021**	**Oct 04, 2021**	**Oct 05, 2021**	**Oct 06, 2021**
Saldo de la posición global = a + b+ c + d + e	49.6	46.4	0.1	50.7
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + o	-63.0	49.2	-133.0	27.1
a. Mercado spot con el público	-57.1	-57.2	-133.6	-114.7
i. Compras	216.8	239.3	367.5	244.7
ii. (-) Ventas	273.9	296.5	501.2	359.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-29.4	-14.3	-177.4	-375.4
i. Pactadas	90.4	94.3	407.3	312.8
ii. (-) Vencidas	119.8	108.5	529.7	638.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	124.2	88.3	-79.3	-173.5
i. Pactadas	260.8	129.1	239.9	415.5
ii. (-) Vencidas	136.6	40.8	319.2	589.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Compras	479.0	225.2	317.5	411.4
ii. A futuro	50.0	25.0	17.0	36.0
e. Operaciones sost asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entregas	8.4	-61.5	-204.9	-45.3
i. Compras	136.6	38.5	317.5	587.7
ii. (-) Ventas	118.2	100.0	522.3	633.1
f. Efecto de Opciones	0.9	2.0	-1.5	-8.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	148.7	197.1	178.7	260.9
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.1280	4.1309	4.1310	4.1352

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera