BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	11 Oct 21	12 Oct 21	13 Oct 21	14 Oct 21	15 Oct 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**24,377.2**	**22,968.2**	**20,175.7**	**17,782.5**	**18,091.3**
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			200.2 121.6	300.0	300.0
Propuestas recibidas			604.9 121.6	373.0	571.4
Plazo de vencimiento			35 d 35 d	23 d	21 d
Tasas de interés: Mínima			1.50 1.50	1.49	1.49
Máxima			1.50 1.50	1.50	1.50
Promedio			1.50 1.50	1.50	1.50
Saldo	18,532.1	18,532.1	18,903.9	19,260.9	17,540.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 18 de Octubre del 2021	3,006.1	3,006.1	3,006.1	3,006.1	1,782.8
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 22 de octubre de 2021	2,026.1	2,026.1	2,026.1	2,026.1	1,782.8
ii. Subasta de Correos Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,503.1	4,602.3	3,873.3	4,073.3	4,073.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 20 de Octubre del 2021	729.0	729.0	160.0	160.0	160.0
Vencimiento de Repo Valores del 18 al 22 de octubre de 2021	729.0	729.0	0.0	0.0	160.0
iii. Subasta de Correos 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 18 al 22 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Correos Temporal de Cartera de Créditos (Alternativa)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,579.2	4,816.2	5,015.1	5,015.1	5,013.5
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 13 de Enero del 2022	0.3	0.3	0.3	0.3	1.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 18 al 22 de octubre de 2021	0.0	0.3	0.3	0.3	0.0
v. Subasta de Correos Temporal de Cartera de Créditos con Garantía del Gobierno Nacional (Regular)					
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 Correos 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 Correos 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 18 al 22 de octubre de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)		300.0	40.0	100.0	100.0
Propuestas recibidas		315.0	795.0	700.0	350.0
Plazo de vencimiento		65 d	30 d	95 d	94 d
Mínimo: Mínima		0.00	0.00	0.00	0.02
Máxima		0.02	0.00	0.03	0.02
Promedio		0.01	0.00	0.01	0.02
Saldo	8974.9	8774.9	8774.9	8774.9	8474.9
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 18 al 22 de octubre de 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 18 al 22 de octubre de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 999.9 14 000.0	2 999.8 14 400.1	2 499.8 12 800.0	1 417.0 12 100.0	1 400.2 12 177.9
Propuestas recibidas	3 799.0 18 096.8	3 323.0 16 600.6	2 782.8 14 031.3	1 417.0 12 700.9	1 638.5 12 177.9
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	1.46 0.90	1.46 1.47	1.46 1.47	1.46 1.46	1.46 1.46
Máxima	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50
Promedio	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49
Saldo	16,399.6	20,399.8	21,299.5	22,016.5	23,494.6
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de Octubre del 2021	14,000.0	14,400.1	12,800.0	12,100.0	15,177.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 22 de octubre de 2021	14,000.0	14,400.1	12,800.0	12,100.0	15,494.6
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 18 al 22 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro 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 18 al 22 de octubre de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			200.0		200.0 150.0
Propuestas recibidas			300.0		300.0 150.0
Plazo de vencimiento			61 d		91 d 91 d
Tasas de interés: Mínima			0.60		0.60 0.60
Máxima			0.60		0.60 0.60
Promedio			0.60		0.60 0.60
Saldo	3,776.0	3,476.0	3,116.0	3,116.0	3,566.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 18 de Octubre del 2021	790.0	520.0	120.0	120.0	150.0
Vencimiento de CDR BCRP del 18 al 22 de octubre de 2021	1,450.0	640.0	120.0	120.0	300.0
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 18 al 22 de octubre de 2021					
iv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,842.0	1,842.0	1,842.0	1,942.0	1,942.0
Próximo vencimiento de Repo Dólares el 19 de Octubre del 2021	40.0	40.0	40.0	40.0	40.0
Vencimiento de REPO del 18 al 22 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	40.0
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 18 al 22 de octubre 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 Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 18 al 22 de octubre 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 Repo Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 18 al 22 de octubre de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	100.0	100.0			50.0 200.0 200.0 200.0
Propuestas recibidas	100.0	150.4			50.0 200.0 200.0 200.0
Plazo de vencimiento	273 d	273 d			91 d 91 d 91 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	0.50	0.57			0.60 0.59 0.60 0.59
Máxima	0.53	0.60			0.60 0.60 0.60 0.60
Promedio	0.53	0.60			0.60 0.60 0.60 0.59
Saldo	31,907.2	31,907.2	31,752.2	31,752.2	32,402.2
Próximo vencimiento de SC - Venta el 18 de Octubre del 2021	100.0	155.0	40.0	40.0	40.0
Vencimiento de SC - Venta del 18 al 22 de octubre de 2021	255.0	155.0	0.0	0.0	757.9
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (REDI)		200.0		200.0	
Propuestas recibidas		200.0		200.0	
Plazo de vencimiento		14 d		14 d	
Tasas de interés: Mínima		0.30		0.30	
Máxima		0.30		0.30	
Promedio		0.30		0.30	
Saldo	400.0	400.0	400.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de REDI el 18 de Octubre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de REDI del 18 al 22 de octubre de 2021	200.0	200.0	0.0	0.0	200.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	200.0	100.0			100.0 100.0
Propuestas recibidas	500.0	400.0			150.0 100.0
Plazo de vencimiento	273 d	273 d			182 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	2.26	2.20			2.01 2.21
Máxima	2.30	2.20			2.01 2.25
Promedio	2.27	2.20			2.01 2.23
Saldo	19,849.9	19,969.9	19,969.9	19,969.9	20,169.9
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 18 al 22 de octubre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0016-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones Cambiarias de la Mesa de Negociación del BCR	0.0	40.4	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)		10.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio		4.0390			
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	13.2	0.0	0.0	2.4
i. Compras (millones de US$)	0.0	13.2		0.0	2.4
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0			
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizadas)	0.0	0.0			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7,377.3**	**5,427.9**	**4,514.1**	**3,865.5**	**3,763.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal directa de valores (Repo tasasa):					
i. Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0062%	0.0062%	0.0063%	0.0064%	0.0065%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	5,305.5	3,679.3	2,930.3	2,463.9	2,130.6
Tasa de interés	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,071.8**	**1,748.6**	**1,583.8**	**1,401.6**	**1,632.6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12,222.6	11,396.6	11,057.0	10,913.0	10,575.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado 7% del TOSEL (*)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6,172.8	5,387.5	5,033.4	4,749.6	4,553.5
Saldo cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado 7% del TOSEL (*)	2.1	2.1	2.1	2.1	2.1
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CRAC´SS					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	240.0	204.0	145.0	55.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
c. Total reporte interbancario de CRAC´SS (CRAC´SS-NR y CRV)	0.0	0.0	0.7	0.0	6.6
Plazo 6 meses (reporte / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (reporte / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (reporte / tasa promedio)					
7. Indicadores de operaciones cambiarias de las empresas bancarias (millones de US$)	**Oct.07. 2021**	**Oct.14. 2021**	**Oct.12. 2021**	**Oct.13. 2021**	**Oct.14. 2021**
Saldo de la posición global (a + b + c + d + e + f + g + h + i)	86.0	30.0	100.4	-134.6	23.1
Flujo de la posición contable (a + b + c) - (d + e + f + g + h + i)	-126.8	-103.7	-143.8	-46.6	34.0
a. Mercado spot con el público	-122.0	-123.4	47.2	7.7	-39.4
i. Compras	415.3	215.5	548.9	473.2	322.3
ii. (-) Ventas	537.3	338.9	501.6	465.5	361.7
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-44.1	136.8	368.6	33.1	-4.9
i. Pactadas	164.0	169.6	652.5	357.3	156.6
ii. (-) Vencidas	208.1	32.9	293.9	324.1	161.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-65.9	46.1	106.6	48.5	209.0
i. Pactadas	157.8	76.9	213.1	393.8	292.2
ii. (-) Vencidas	223.7	30.8	106.5	345.3	83.3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	351.7	225.5	521.6	727.1	291.6
ii. A futuro	14.0	31.0	40.0	0.0	0.0
e. Operaciones sord asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	14.0	22.0	-188.1	37.5	-86.0
i. Compras	211.1	77.4	109.8	337.6	85.3
ii. (-) Ventas	197.1	0.3	291.9	300.1	146.3
f. Efecto de Opciones	20.0	8.4	-2.9	-7.8	1.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-3.2	14.2	-193.3	-119.4	226.5
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0919	4.0705	4.0648	3.8912	3.9325

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera