BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	2 Nov 21	3 Nov 21	4 Nov 21	5 Nov 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**19,247.2**	**18,641.5**	**18,234.1**	**18,493.2**
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)				
Posturas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	15,527.4	15,527.4	15,527.4	15,527.4
Próximo vencimiento de CD BCRP del 05 de Noviembre del 2021	2,122.6	2,122.6	2,122.6	2,122.6
Vencimiento de CD BCRP del 08 al 12 de noviembre de 2021	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	4,313.3	4,313.3	4,613.3	4,613.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Enero del 2022	0.9	0.9	0.9	0.9
Vencimiento de Repo Valores del 08 al 12 de noviembre de 2021	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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 08 al 12 de noviembre de 2021	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	5,412.4	5,412.4	5,612.4	5,612.4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 13 de Enero del 2022	1.6	1.6	1.6	1.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 08 al 12 de noviembre de 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				
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
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
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 Repo Especial - CDR del 08 al 12 de noviembre de 2021				
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				
Posturas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Mínimo: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	10484.9	10484.9	10484.9	10484.9
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 12 de Noviembre del 2021	110.0	110.0	110.0	110.0
Vencimientos de CDV BCRP del 08 al 12 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	110.0
ix. Subasta de Certificados de Depósitos Liquidables en Dólares del BCR (CDLD BCRP)				
Posturas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo				
Próximo vencimiento de CDLD BCRP				
Vencimiento de CDLD BCRP del 08 al 12 de noviembre de 2021				
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 500.0 9 100.0	1 499.9 9 600.0	1 500.0 9 425.8	1 000.1 10 000.1
Posturas recibidas	1 989.6 9 741.0	1 848.6 10 016.0	1 617.0 9 425.8	1 290.4 10 984.8
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	1.40 1.40	1.40 1.40	1.40 1.40	1.40 1.40
Máxima	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50
Promedio	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.49
Saldo	14,437.4	14,972.3	14,964.4	15,500.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 8 de Noviembre del 2021	10,565.0	10,913.7	10,484.5	10,000.1
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 08 al 12 de noviembre de 2021	13,937.4	11,972.4	10,484.5	15,500.1
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)				
Posturas 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 08 al 12 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	1,000.0
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 08 al 12 de noviembre de 2021				
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)				
Posturas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	2,210.0	2,060.0	2,060.0	2,060.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 10 de Noviembre del 2021	150.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de CDR BCRP del 08 al 12 de noviembre de 2021	150.0	0.0	0.0	510.0
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 08 al 12 de noviembre de 2021				
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)				
Posturas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	1,902.0	1,902.0	2,002.0	1,972.0
Próximo vencimiento de Swap Cambiario el 26 de Noviembre del 2021	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 08 al 12 de noviembre de 2021	30.0	30.0	30.0	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 08 al 12 de noviembre de 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 Expansion				
Vencimiento REPO Expansión del 08 al 12 de noviembre 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 Reso Sustitución				
Vencimiento de REPO Sustitución del 08 al 12 de noviembre de 2021				
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 199.9 199.9 200.0 300.1	200.0 300.0 200.0	200.0 200.0 200.0	200.0 120.0
Posturas recibidas	301.0 460.0 470.0 790.0 880.0	490.0 950.0 280.0	200.0 490.0 510.0	700.0 120.0
Plazo de vencimiento	273 d 273 d 273 d 273 d 273 d	273 d 273 d 274 d	273 d 273 d 273 d	276 d 276 d
Tasas de interés: Mínima	0.58 0.58 0.58 0.54 0.54	0.55 0.53 0.55	0.52 0.49 0.48	0.49 0.53
Máxima	0.60 0.60 0.58 0.55 0.55	0.59 0.56 0.57	0.53 0.50 0.49	0.52 0.60
Promedio	0.59 0.59 0.58 0.55 0.55	0.58 0.54 0.56	0.53 0.48 0.48	0.51 0.58
Saldo	35,234.8	35,314.8	35,149.3	35,079.3
Próximo vencimiento de SC-Venta el 8 de Noviembre del 2021	620.0	765.5	390.0	95.0
Vencimiento de SC - Venta del 08 al 12 de noviembre de 2021	1,775.5	1,155.5	390.0	1,373.1
xx. Subasta de Reso de Valores para ofrecer dólares (RED)			200.0	
Posturas recibidas			200.0	
Plazo de vencimiento			14 d	
Tasas de interés: Mínima			0.30	
Máxima			0.30	
Promedio			0.30	
Saldo	600.0	600.0	600.0	600.0
Próximo vencimiento de RED el 5 de Noviembre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de RED del 08 al 12 de noviembre de 2021	200.0	200.0	200.0	400.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0	200.0	200.0	200.0
Posturas recibidas	300.0	425.0	600.0	550.0
Plazo de vencimiento	181 d	181 d	181 d	181 d
Tasas de interés: Mínima	2.12	2.14	2.19	2.21
Máxima	2.12	2.14	2.19	2.21
Promedio	2.12	2.14	2.19	2.21
Saldo	22,419.9	22,619.9	22,819.9	23,019.9
Próximo vencimiento de Swas Tasas de Interés el 23 de Noviembre del 2021	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Swas de Tasas de Interés del 08 al 12 de noviembre de 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 Interbancarias en la Mesa de Negociación del BCR	1,082.1	923.0	172.6	297.1
i. Contratos (millones de US$)				
Tipo de cambio promedio				
ii. Ventas (millones de US$)	270.0	230.0	43.0	74.0
Tipo de cambio promedio	4.0077	4.0130	4.0140	4.0150
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	-34.4	0.0	9.8
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.6		9.8
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	35.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valoricen)				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7,565.1**	**6,618.6**	**7,135.7**	**7,195.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal directa de valores (subasta)				
Contratos (tasa efectiva diaria)	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0054%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
c. Crédito por readicción monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,259.3	890.5	991.5	1,737.0
Tasa de interés	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**6,305.8**	**5,728.1**	**6,144.2**	**5,458.9**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	8,745.1	7,441.8	11,013.2	11,383.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.0	3.4	5.0	5.2
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2,753.8	1,121.8	4,726.8	5,038.1
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.4	0.5	2.2	2.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CTVN/DD				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	697.0	904.0	661.0	728.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	232.0	272.0	60.0	130.0
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 CTVN/DD (CTVN/DD MD y CTVN/DD MS)	n.n	n.n	n.n	n.n
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)				
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)				
7. Operaciones con derivados cambiarios con empresas bancarias (millones de US$)	**Oct 29, 2021**	**Nov 02, 2021**	**Nov 03, 2021**	**Nov 04, 2021**
Posición de la cuenta global: a = a.1 + a.2 + a.3 + a.4 + a.5	-55.8	511.9	-20.3	199.4
Flujo de la posición contable: b = a + b.1 - c.1 + e + o	-4.6	-55.8	61.4	77.6
a. Mercado spot con el público	24.1	-144.8	-139.8	35.9
i. Compras	353.6	310.9	300.0	355.0
ii. (-) Ventas	329.5	455.7	439.7	319.1
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-15.7	164.7	-86.5	-35.0
i. Pactadas	188.9	293.4	109.1	285.4
ii. (-) Vencidas	204.6	128.7	197.4	320.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-64.2	130.1	43.7	108.3
i. Pactadas	264.8	371.1	298.6	374.3
ii. (-) Vencidas	329.0	241.0	254.9	266.0
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. A Vencimiento	419.6	257.0	345.4	366.5
ii. A futuro	0.0	20.0	7.0	49.8
e. Operaciones sect asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	92.9	48.9	65.5	-55.5
i. Compras	294.4	195.7	290.4	201.4
ii. (-) Ventas	161.7	106.8	185.1	318.9
f. Efecto de Opciones	0.9	0.9	0.0	-1.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-52.8	284.5	212.5	0.4
h. Crédito por readicción monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9910	4.0076	4.0126	4.0102

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera