BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	22 Nov 21	23 Nov 21	24 Nov 21	25 Nov 21	26 Nov 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**12,611.1**	**13,793.8**	**14,048.3**	**13,996.9**	**14,173.9**
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	14,875.8	14,875.8	14,875.8	14,875.8	14,875.8
Próximo vencimiento de CD BCRP el 30 de Noviembre del 2021	213.0	213.0	213.0	213.0	213.0
Vencimiento de CD BCRP del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,763.3	4,763.3	4,763.3	4,913.3	4,913.3
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 27 de Enero del 2022	0.9	0.9	0.9	0.9	0.9
Vencimiento de Reso Valores del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	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	0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Reso de Cartera General del 29 de noviembre al 03 de diciembre 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	5,894.9	5,894.9	5,893.3	6,172.7	6,172.7
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 13 de Enero del 2022	1.6	1.6	1.6	1.6	1.6
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 29 de noviembre al 03 de diciembre 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 (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	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 Reso Especial - CDR del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas	190.0	160.0	200.0	160.0	
Plazo de vencimiento	200.0	260.0	240.0	180.0	
Mínimo:	88 d	94 d	93 d	92 d	
Mínima	0.04	0.04	0.04	0.04	
Máxima	0.04	0.04	0.04	0.04	
Promedio	0.04	0.04	0.04	0.04	
Saldo	11,014.7	10,814.7	11014.7	11,174.7	11,174.7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 30 de Noviembre del 2021	360.0	2000.0	2000.0	2000.0	2000.0
Vencimiento de CDV BCRP del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	360.0	0.0	0.0	0.0	2000.0
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 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 500.0 8 600.1	1 500.1 9 299.9	1 499.6 8 945.8	1 500.0 9 432.3	1 489.4 9 382.4
Propuestas recibidas	1 731.6 8 921.5	1 564.8 9 525.7	1 499.6 8 945.8	1 565.5 9 432.3	1 489.4 9 382.4
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	1.98 1.97	1.98 1.97	1.98 1.97	1.98 1.97	1.98 1.95
Máxima	2.00 1.99	2.00 1.99	2.00 1.99	2.00 1.99	2.00 1.99
Promedio	2.00 1.99	2.00 1.99	2.00 1.99	2.00 1.99	2.00 1.99
Saldo	15,792.3	16,492.4	16.145.2	16.931.8	16,871.5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 29 de Noviembre del 2021	10,099.9	10,792.6	10,145.7	10.932.1	10,882.4
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	14,292.3	13,492.3	11.645.5	10.932.1	16,871.5
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	500.0	500.0			
Propuestas recibidas	954.0	970.0			
Plazo de vencimiento	91 d	90 d			
Tasas de interés: Mínima	2.35	2.35			
Máxima	2.72	2.80			
Promedio	2.72	2.80			
Saldo	3,966.9	4,466.9	4.466.9	4,466.9	4,466.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 29 de Noviembre del 2021	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	500.0
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 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,550.0	1,550.0	1,550.0	1,550.0	1,550.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Diciembre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,972.0	1,972.0	1,972.0	1,972.0	1,942.0
Próximo vencimiento de Repo Dólar el 5 de Febrero del 2022	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	30.0	30.0	30.0	30.0	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 29 de noviembre al 03 de diciembre 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 Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 29 de noviembre al 03 de diciembre 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 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	100.0 172.0	200.0 200.0	101.0 200.0 200.0	151.0	180.0
Propuestas recibidas	170.0 172.0	370.0 352.0	121.0 307.0 206.0	151.0	180.0
Plazo de vencimiento	182 d 365 d	365 d 365 d	364 d 364 d 364 d	365 d	364 d
Tasas de interés: Mínima	0.57 0.54	0.49 0.49	0.49 0.49 0.49	0.51	0.51
Máxima	0.59 0.60	0.53 0.52	0.51 0.53 0.52	0.57	0.54
Promedio	0.59 0.57	0.53 0.51	0.51 0.53 0.52	0.57	0.54
Saldo	35,363.3	36,528.3	35,821.3	35,972.3	36,115.8
Próximo vencimiento de SC-Venta el 1 de Diciembre del 2021	235.0	208.0	36.5	36.5	388.5
Vencimiento de SC - Venta del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	479.5	244.5	36.5	36.5	1,695.4
xx. Subasta de Repo de Valores para mesas dólares (SDTV)		150.0			150.0
Propuestas recibidas		150.0			150.0
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	500.0	450.0	450.0	450.0	450.0
Próximo vencimiento de RED el 2 de Diciembre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	100.0
Vencimiento de RED del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	400.0	200.0	200.0	200.0	100.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés					50.0
Propuestas recibidas					100.0
Plazo de vencimiento					273 d
Tasas de interés: Mínima					2.72
Máxima					2.72
Promedio					2.72
Saldo	73,419.9	73,719.9	73,719.9	73,819.9	73,969.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 30 de Noviembre del 2021	100.0	200.0	300.0	300.0	200.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 29 de noviembre al 03 de diciembre 2021	900.0	800.0	600.0	300.0	800.0
b. Liquid. Repos Carteras de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0023-2020-BCRP)					
c. Operaciones Fuera de Mesa (Millones de US$)	20.1	0.0	4.0	32.3	20.2
i. Compras (Millones de US$)	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (Millones de US$)	5.0	0.0	1.0	8.0	5.0
Tipo de cambio promedio	4.0250	0.0000	4.0260	4.0320	4.0450
d. Operaciones Fuera de Mesa (Millones de US$)	0.0	-9.8	-2.6	2.3	1.7
i. Compras (Millones de US$)	n.o.	0.2	2.4	2.5	1.7
ii. Ventas (Millones de US$)	0.0	10.0	10.0		
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes del cierre de operaciones	**3,800.9**	**3,325.8**	**3,380.9**	**2,872.3**	**3,261.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Corrección (tasa efectiva diaria)	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0071%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2,514.9	2,381.5	2,759.7	2,265.9	2,567.5
Tasa de interés	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,296.0**	**944.3**	**621.2**	**606.4**	**693.5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	6,138.3	6,534.6	6,759.9	6,963.6	7,218.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.1	5.8	5.0	4.0	4.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,613.1	3,513.7	3,382.4	3,369.4	3,166.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.8	1.8	1.7	1.7	1.6
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	920.0	235.0	166.0	155.0	166.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	240.0	238.0	180.0	238.0	238.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDLD	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.	n.o.
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Nov.19, 2021**	**Nov.22, 2021**	**Nov.23, 2021**	**Nov.24, 2021**	**Nov.25, 2021**
Saldo de la posición global de operaciones forwards	99.4	77.5	48.8	2.4	2.4
Saldo de la posición activa de futuros	31.8	-89.6	-20.8	-26.9	-45.0
b. Mercado spot con el público	42.6	-150.9	-18.1	-30.1	-54.5
i. Compras	263.9	226.9	321.9	267.8	172.0
ii. (-) Ventas	221.3	377.7	340.0	298.0	226.4
c. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	106.5	47.5	137.4	106.5	34.6
i. Pactadas	159.2	256.1	194.6	324.6	45.2
ii. (-) Vencidas	52.9	208.5	532.1	431.1	10.6
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-17.9	-64.2	-255.9	-62.3	3.1
i. Pactadas	199.3	142.3	160.6	424.7	50.7
ii. (-) Vencidas	217.2	206.5	416.5	487.0	47.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	203.5	289.1	455.6	676.5	193.0
ii. A futuro	0.0	0.0	0.0	138.0	87.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	155.2	76.3	-115.9	54.8	38.9
i. Compras	356.5	274.5	400.8	485.5	48.1
ii. (-) Ventas	51.1	148.2	518.8	428.8	7.2
f. Efecto de Opciones	0.4	-2.5	0.1	-1.0	-0.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-122.4	36.3	33.2	69.8	45.0
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0214	4.0221	4.0074	4.0224	4.0281

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera