BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	6 Dic 21	7 Dic 21	9 Dic 21	10 Dic 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**15 996,8**	**18 213,7**	**19 492,8**	**18 723,1**
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)				199.9
Propuestas recibidas				555.1
Plazo de vencimiento				35 d
Tasas de interés: Mínima				2.00
Máxima				2.49
Promedio				2.49
Saldo	14 662.8	14 662.8	14 662.8	14 962.7
Próximo vencimiento de CD BCRP el 17 de Diciembre del 2021	2 081.4	2 081.4		2 081.4
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de Diciembre 2021	0.0	0.0		2 081.4
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	200.0	200.0		
Propuestas recibidas	400.0	330.0		
Plazo de vencimiento	31 d	31 d		
Tasas de interés: Mínima	2.70	2.43		
Máxima	2.70	2.70		
Promedio	2.70	2.56		
Saldo	5 463.3	5 663.3	5 663.3	5 663.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Enero del 2022		200.0		200.0
Vencimiento de Repo Valores del 13 al 17 de Diciembre 2021		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
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General		0.0		0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 13 al 17 de Diciembre 2021		0.0		0.0
iv. Subasta de Compra Temporal de Cartera de Créditos (Alternativo)				
Propuestas recibidas				
Plazo de vencimiento				
Tasas de interés: Mínima				
Máxima				
Promedio				
Saldo	6 451.5	6 451.5	6 451.5	6 451.5
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 13 de Enero del 2022		1.6		1.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 13 al 17 de Diciembre 2021		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
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
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 13 al 17 de Diciembre 2021				
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				300.0
Propuestas recibidas				475.0
Plazo de vencimiento				87 d
Márgen: Mínima				0.04
Máxima				0.04
Promedio				0.04
Saldo	11 074.5	11 074.5	11074.5	11374.5
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 13 de Diciembre del 2021		2 399.9		2399.9
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 de Diciembre 2021		0.0		2699.9
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 13 al 17 de Diciembre 2021				
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	9 799.9	11 000.0	11 799.9	1 999.9 9 800.0
Propuestas recibidas	10 021.3	11 592.8	13 792.4	2 309.5 12 193.1
Plazo de vencimiento	1 d	2 d	1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	1.97	1.97	1.97	1.98 1.98
Máxima	2.00	2.00	2.00	2.50 2.49
Promedio	1.99	1.99	1.99	2.50 2.46
Saldo	11 660.0	11 933.1	11 799.9	11 799.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de Diciembre del 2021		11 933.1		9 800.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de Diciembre 2021		11 933.1		11 799.9
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	500.0			
Propuestas recibidas	782.4			
Plazo de vencimiento	182 d			
Tasas de interés: Mínima	2.46			
Máxima	3.00			
Promedio	2.65			
Saldo	4 500.2	4 500.2	4 500.2	4 500.2
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 16 de Diciembre del 2021		500.0		500.0
Vencimiento de Coloc-TP del 13 al 17 de Diciembre 2021		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 13 al 17 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	1 950.0	1 950.0	1 950.0	1 950.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 13 de Diciembre del 2021		200.0		200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de Diciembre 2021		0.0		400.0
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 13 al 17 de Diciembre 2021				
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	100.1	100.0		200.0
Propuestas recibidas	262.0	294.0		436.0
Plazo de vencimiento	31 d	31 d		31 d
Tasas de interés: Mínima	2.95	2.75		3.00
Máxima	3.00	2.97		3.50
Promedio	2.96	2.95		3.04
Saldo	2 142.1	2 242.1	2 242.1	2 442.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Enero del 2022		100.0		100.0
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de Diciembre 2021		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 Repo				
Vencimiento de REPO del 13 al 17 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 Repo Expansion				
Vencimiento de REPO Expansión del 13 al 17 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 Repo Sustitucion				
Vencimiento de REPO Sustitución del 13 al 17 de Diciembre 2021				
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 200.0 120.0 200.0 200.0	50.0 40.0	80.0 20.0	
Propuestas recibidas	390.0 240.0 120.0 250.0 200.0	70.0 40.0	80.0 20.0	
Plazo de vencimiento	182 d 182 d 182 d 182 d 183 d	365 d 182 d	182 d 182 d	
Tasas de interés: Mínima	0.45 0.48 0.50 0.54 0.58	0.60 0.45	0.60 0.56	
Máxima	0.53 0.51 0.60 0.60 0.60	0.60 0.45	0.60 0.56	
Promedio	0.51 0.49 0.56 0.57 0.59	0.60 0.45	0.60 0.56	
Saldo	38 210.5	38 100.5	38 200.5	37 901.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el 13 de Diciembre del 2021		299.5		114.8
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de Diciembre 2021		299.5		1 161.9
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)		120.0		120.0
Propuestas recibidas		120.0		120.0
Plazo de vencimiento		14 d		13 d
Tasas de interés: Mínima		0.30		0.30
Máxima		0.30		0.30
Promedio		0.30		0.30
Saldo	380.0	350.0	350.0	320.0
Próximo vencimiento de RED el 16 de Diciembre del 2021		150.0		80.0
Vencimiento de RED del 13 al 17 de Diciembre 2021		150.0		80.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0	50.0		
Propuestas recibidas	200.0	100.0		
Plazo de vencimiento	90 d	182 d		
Tasas de interés: Mínima	2.36	2.67		
Máxima	2.36	2.70		
Promedio	2.36	2.69		
Saldo	21 769.9	21 619.9	21 619.9	21 419.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 13 de Diciembre del 2021		200.0		100.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 13 al 17 de Diciembre 2021		200.0		700.0
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	49.0	12.2	188.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (millones de US$)	12.0	3.0	46.0	
Tipo de cambio promedio	4.0860	4.0800	4.0860	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	-22.7	0.6	0.7	3.8
i. Compras (millones de US$)	0.3	0.6	0.7	3.8
ii. Ventas (millones de US$)	23.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR				
ii. Compras de BTP (Valorizado)				
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6 948.0**	**7 501.5**	**7 504.9**	**6 623.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones				
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).				
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0062%	0.0068%	0.0062%	0.0087%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0			
Tasa de interés	2.50%	2.50%	2.50%	3.00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional				
Tasa de interés				
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 286.0	2 132.9	1 433.3	2 447.3
Tasa de interés	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5 662.0**	**5 368.6**	**6 071.6**	**4 176.6**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	12 521.7	12 474.8	11 817.8	11 898.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6.5	6.4	6.8	6.8
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 002.6	5 953.9	5 869.4	5 889.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.1	3.1	3.4	3.4
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP				
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	595.0	629.0	620.0	820.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.00 / 2.00 / 2.00	2.50 / 2.50 / 2.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	210.0	229.0	212.0	213.0
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 CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0
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$)	**Dic.03. 2021**	**Dic.06. 2021**	**Dic.07. 2021**	**Dic.09. 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	12.2	-88.2	-149.5	63.0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	70.0	-63.5	-107.8	-25.1
a. Mercado spot con el público	-109.5	-88.5	-120.0	-71.7
i. Compras	250.9	209.8	314.5	363.4
ii. (-) Ventas	360.4	298.3	434.5	435.1
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	98.5	-167.7	-58.0	-69.6
i. Pactadas	279.3	240.1	118.1	205.8
ii. (-) Vencidas	180.8	407.8	176.1	275.4
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	111.4	-193.4	-44.1	-132.9
i. Pactadas	244.1	424.8	174.2	262.7
ii. (-) Vencidas	132.7	618.2	218.3	395.6
d. Operaciones cambiarias interbancarias				
i. Al contado	219.3	237.9	227.7	261.0
ii. A futuro	43.0	13.0	10.0	84.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-28.6	223.9	53.0	120.9
i. Compras	124.4	615.7	214.9	384.1
ii. (-) Ventas	153.1	391.8	161.9	263.2
f. Efecto de Opciones	-0.4	-4.9	4.0	0.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	115.5	-34.0	-30.5	70.4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera				
Tasa de interés				
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0766	4.0842	4.0760	4.0841
(*) Datos preliminares				

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera