BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	6 Set 21		7 Set 21		8 Set 21	9 Set 21	10 Set 21	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**22,763.2**		**23,936.8**		**24,668.6**	**27,706.9**	**30,483.7**	
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	28,740.3		28,740.3		28,740.3	28,740.3	27,340.3	
Próximo vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de setiembre 2021	1,400.0		1,400.0		1,400.0	1,400.0	2,923.0	
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de setiembre 2021	1,400.0		1,400.0		1,400.0	1,400.0	2,923.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	7,765.4		7,765.4		7,765.4	7,765.4	6,965.4	
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 13 de Setiembre del 2021	1,500.0		1,500.0		1,500.0	800.0	700.0	
Vencimiento de Reso Valores del 13 al 17 de setiembre 2021	0.0		0.0		0.0	800.0	700.0	
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					
Vencimiento de Reso de Cartera General del 13 al 17 de setiembre 2021	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	2,885.7		2,927.9		2,960.4	2,960.4	2,959.7	
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 13 de Setiembre del 2021	2.5		2.5		2.5	2.5	2.5	
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 13 al 17 de setiembre 2021	0.0		0.0		0.0	0.0	2.5	
v. Subasta de Compra 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 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 Repo Especial - CDR del 13 al 17 de setiembre 2021								
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	300.0		300.0		300.0	300.0	699.9	
Propuestas recibidas	800.0		799.0		500.0	700.0	999.0	
Plazo de vencimiento	85 d		84 d		98 d	95 d	94	
Tasas de interés: Mínima	0.00		0.00		0.00	0.00	0.00	
Máxima	0.00		0.00		0.00	0.00	0.00	
Promedio	0.00		0.00		0.00	0.00	0.00	
Saldo	2950.0		2950.0		3150.0	3450.0	4149.9	
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de noviembre de 2021	850.0		850.0		850.0	850.0	850.0	
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 de setiembre 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 13 al 17 de setiembre 2021								
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	743.0	14 399.7	200.4	17 350.1	19 800.0	22 400.1	3 000.0	21 832.1
Propuestas recibidas	743.0	16 553.0	200.4	18 543.2	20 274.9	22 660.5	3 036.5	21 861.1
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	1 d	1 d	7 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	0.40	0.50	0.40	0.40	0.40	0.40	0.50	0.50
Máxima	0.50	0.50	0.50	0.50	0.50	1.00	1.00	1.00
Promedio	0.50	0.50	0.50	0.50	0.50	0.50	0.98	1.00
Saldo	23,643.1		25,293.7		25,743.5	25,843.5	25,775.5	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo al 13 de Setiembre del 2021	15,899.9		19,350.2		22,300.1	24,900.1	22,575.1	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de setiembre 2021	22,900.1		24,350.5		24,900.1	24,900.1	25,775.5	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	4,664.5		4,664.5		4,664.5	4,664.5	4,664.5	
Próximo vencimiento de Coloc TP el 17 de Setiembre del 2021	152.2		152.2		152.2	152.2	152.2	
Vencimiento de Coloc TP del 13 al 17 de setiembre 2021	0.0		0.0		0.0	0.0	152.2	
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 setiembre 2021								
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	6,222.0		5,562.0		5,562.0	5,511.0	5,511.0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP al 13 de Setiembre del 2021	660.0		51.0		51.0	90.0	90.0	
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de setiembre 2021	711.0		51.0		51.0	0.0	365.0	
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 setiembre 2021								
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)								
Propuestas recibidas								
Plazo de vencimiento								
Tasas de interés: Mínima								
Máxima								
Promedio								
Saldo	1,872.0		1,872.0		1,872.0	1,872.0	1,872.0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 27 de Setiembre del 2021	30.0		30.0		30.0	30.0	30.0	
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de setiembre 2021	0.0		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								
Próximos vencimiento de Reso								
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de setiembre 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 Extensión								
Vencimiento de REPO Extensión del 13 al 17 de setiembre 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 13 al 17 de setiembre 2021								
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					95.0	25.0	35.0 95.0 60.0	
Propuestas recibidas					120.0	25.0	249.0 359.0 80.0	
Plazo de vencimiento					61 d	61 d	60 d 33 d 60 d	
Tasas de interés: Mínima					0.60	0.60	60.0 60.0 60.0	
Máxima					0.60	0.60	60.0 60.0 60.0	
Promedio					0.60	0.60	60.0 60.0 60.0	
Saldo	26,710.2		26,710.2		26,624.7	26,318.2	26,508.2	
Próximo vencimiento de SC Venta el 13 de Setiembre del 2021	180.5		180.5		331.5	800.1	800.1	
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de setiembre 2021	512.0		512.0		331.5	0.0	800.1	
xx. Subasta de Reso de Valores para canjear dólares (RED)	200.0						200.0	
Propuestas recibidas	254.0						200.0	
Plazo de vencimiento	14 d						14 d	
Tasas de interés: Mínima	0.30						0.35	
Máxima	0.34						0.35	
Promedio	0.31						0.35	
Saldo	935.0		935.0		935.0	777.0	883.0	
Próximo vencimiento de RED el 14 de Setiembre del 2021	158.0		158.0		158.0	94.0	158.0	
Vencimiento de RED del 13 al 17 de setiembre 2021	252.0		252.0		252.0	94.0	483.0	
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	200.0	200.0	200.0	200.0	300.0	400.0	200.0	400.0 200.0
Propuestas recibidas	1030.0	1200.0	600.0	600.0	1150.0	700.0	500.0	1300.0 550.0
Plazo de vencimiento	91 d	181 d	273 d	91 d	181 d	273 d	91 d	181 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	0.87	1.29	1.36	0.90	1.31	1.42	1.30	1.66 1.75
Máxima	0.87	1.32	1.37	0.90	1.32	1.45	1.45	1.76 1.85
Promedio	0.87	1.31	1.36	0.90	1.32	1.43	1.37	1.71 1.80
Saldo	6,249.9		6,949.9		6,949.9	6,949.9	7,749.9	
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 13 al 17 de setiembre 2021	0.0		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 Mesa de Negociación del BCR	201.1		410.6		28.7	118.9	459.4	
i. Compras (millones de US$)								
Tipo de cambio promedio								
ii. Ventas (millones de US$)	49.0		100.0		7.0	29.0	112.0	
Tipo de cambio promedio	4.1031		4.1060		4.0950	4.1010	4.1018	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.1		0.0		3.4	0.0	8.4	
i. Compras (millones de US$)	0.1		0.0		3.4	0.0	8.4	
ii. Ventas (millones de US$)								
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 + CD BCRP-NR								
ii. Compras de BTP (Valorizado)	0.0		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	**7,315.3**		**5,675.7**		**4,536.5**	**4,859.8**	**4,483.9**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones								
a. Compra temporal de valores (Reporte de Liquidez)								
Comisión-tasa efectiva diaria	0.0037%		0.0037%		0.0037%	0.0037%	0.0045%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0		0.0		0.0	0.0	0.0	
Tasa de interés	1.00%		1.00%		1.00%	1.00%	1.00%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional								
Tasa de interés								
d. Desdoblos Overnight en moneda nacional	2,296.6		1,554.8		1,620.2	1,336.4	2,296.6	
Tasa de interés	0.05%		0.30%		0.30%	0.30%	0.05%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4,822.7**		**4,120.9**		**2,916.3**	**3,552.6**	**2,187.3**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de $) (*)	11,501.6		11,437.5		11,284.2	10,872.6	10,842.8	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado Rc de TCEM (*)	2.0		2.0		2.0	2.0	2.0	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de $)	5,157.0		5,053.7		4,949.4	4,500.8	4,469.6	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado Rc de TCEM (*)	2.5		2.5		2.4	2.2	2.2	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP								
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	60.0		64.0		76.0	212.0	180.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	0.50 / 0.50 / 0.50		0.50 / 0.50 / 0.50		0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50	1.00 / 1.00 / 1.00	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	154.0		149.0		120.0	120.0	116.0	
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 CTM	50.5		50.5		45.5	0.4	0.0	
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)								
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)								
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)								
7. Operaciones Interbancarias con Instituciones Bancarias (millones de US$)	**Set 03, 2021**		**Set 06, 2021**		**Set 07, 2021**	**Set 08, 2021**	**Set 09, 2021**	
Saldo de la cuenta corriente: = a + b + c + d + e + f + g + h	20.8		134.5		30.7	-87.7	31.4	
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + f + g	-106.9		-44.7		-88.1	-112.6	-31.7	
a. Mercado spot con el público	35.5		-73.4		-75.6	-138.5	-92.3	
i. Compras	281.2		134.5		284.5	220.3	276.9	
ii. (-) Ventas	285.7		207.9		360.1	358.8	369.2	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	40.6		15.1		116.9	161.7	-78.7	
i. Pactadas	148.0		23.4		528.8	366.3	347.0	
ii. (-) Vencidas	87.0		8.2		371.9	204.7	425.7	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	179.4		-15.9		35.5	66.1	-113.1	
i. Pactadas	233.7		10.9		281.4	293.1	191.0	
ii. (-) Vencidas	54.3		26.7		245.9	227.0	304.1	
d. Operaciones cambiarias interbancarias								
i. Al contado	429.0		128.1		276.1	529.4	383.4	
ii. A futuro	30.0		10.0		9.0	27.0	20.0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-12.9		4.8		-60.0	48.5	-63.5	
i. Compras	45.6		5.3		242.7	397.8	297.5	
ii. (-) Ventas	58.4		0.5		302.7	159.3	360.8	
f. Efecto de Opciones	2.2		-0.6		-1.1	-0.1	-0.8	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	53.3		42.4		-78.5	-24.9	-80.9	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera								
Tasa de interés								
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0927		4.1035		4.1021	4.0878	4.0888	
(*) Datos preliminares								

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera