BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	13 Set 21	14 Set 21	15 Set 21	16 Set 21	17 Set 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**28,813.4**	**24,969.7**	**21,514.2**	**18,083.1**	**18,742.5**
2. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					
Propuestas recibidas	168.5	300.0	217.0	300.0	297.3
Plazo de vencimiento	364 d	364 d	364 d	364 d	364 d
Tasas de interés: Mínima	0.96	1.00	0.99	1.00	1.00
Máxima	01.0	1.00	1.00	1.00	1.00
Promedio	01.0	1.00	1.00	1.00	1.00
Saldo	25,176.8	25,576.8	25,893.8	26,293.8	26,200.1
Próximo vencimiento de CD BCRP al 17 de Setiembre del 2021	491.0	491.0	491.0	491.0	3,700.6
Vencimiento de CD BCRP del 17 de setiembre 2021	491.0	491.0	491.0	491.0	4,211.6
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6,265.4	6,276.3	6,276.3	6,376.3	6,376.3
Próximo vencimiento de Reco de Valores al 20 de Setiembre del 2021	275.0	275.0	275.0	275.0	275.0
Vencimiento de Reco Valores del 17 de setiembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	750.0
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 Reco de Cartera General del 17 de setiembre 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	2,962.3	3,162.1	3,162.1	3,362.1	3,362.1
Próximo vencimiento de Reco de Cartera Alternativa el 15 de Octubre del 2021	0.3	0.3	0.3	0.3	0.3
Vencimiento de Reco de Cartera Alternativa del 17 de setiembre 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 Repo Especial - CDR del 17 de setiembre 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	600.0	85.0 500.0	700.0	500.0	210.0
Propuestas recibidas	1,500.0	275.0 1,645.0	1,500.0	500.0	500.0
Plazo de vencimiento	91 d	188 d 90 d	98 d	95 d	94 d
Mínimo: Mínima	0.00	0.00 0.00	0.00	0.00	0.00
Máxima	0.00	0.00 0.00	0.00	0.00	0.00
Promedio	0.00	0.00 0.00	0.00	0.00	0.00
Saldo	8,549.9	8,534.9	8,534.9	8,534.9	8,543.9
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de Noviembre del 2021	850.0	850.0	850.0	850.0	850.0
Vencimientos de CDV BCRP del 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 17 de setiembre 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 788.4 20 799.7	2 096.5 18 066.7	1 683.0 14 708.3	1 858.2 11 900.2	1 897.0 11 737.9
Propuestas recibidas	2 788.4 21 303.3	2 096.5 18 066.7	1 683.0 14 708.3	1 858.2 12 174.8	1 897.0 11 737.9
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	n.op n.op	n.op n.op	n.op n.op	n.op n.op	n.op n.op
Máxima	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00
Promedio	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00	1.00 1.00
Saldo	26,788.5	25,951.6	24,276.2	23,326.3	22,061.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 17 de Setiembre del 2021	21,000.1	18,066.7	14,708.3	14,900.2	14,526.3
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 17 de setiembre 2021	24,000.1	21,066.7	17,708.3	14,900.2	22,061.0
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	4,512.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 17 de Setiembre del 2021	152.2	152.2	152.2	152.2	1,000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 17 de setiembre 2021	152.2	152.2	152.2	152.2	0.0
xii. Subasta de Colocación TP 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 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	5,431.0	5,431.0	5,431.0	5,431.0	5,146.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP al 17 de Setiembre del 2021	275.0	275.0	275.0	275.0	40.0
Vencimiento de CDR BCRP del 17 de setiembre 2021	275.0	275.0	275.0	275.0	310.0
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					
Vencimiento de CD BCRP del 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 Reco Dólares al 22 de Setiembre del 2021	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 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					
Próximo vencimiento de Reso					
Vencimiento de REPO del 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 Extension					
Vencimiento de REPO Extensión del 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 17 de setiembre 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	62.0 30.0 50.0		21.0		
Propuestas recibidas	62.0 30.0 70.0		25.0		
Plazo de vencimiento: Mínima	60 d 60 d 63 d		61 d		
Tasas de interés: Mínima	0.60 0.60 0.60		0.60		
Máxima	0.60 0.60 0.60		0.60		
Promedio	0.60 0.60 0.60		0.60		
Saldo	25,850.1	25,850.1	25,871.1	25,871.1	25,871.1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 20 de Setiembre del 2021	722.0	722.0	722.0	722.0	722.0
Vencimiento de SC - Venta del 17 de setiembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	1,340.0
xx. Subasta de Reso de Valores para comprar dólares (REDI)		200.0		195.0	
Propuestas recibidas		200.0		195.0	
Plazo de vencimiento		14 d		14 d	
Tasas de interés: Mínima		0.30		0.30	
Máxima		0.30		0.32	
Promedio		0.30		0.30	
Saldo	883.0	900.0	900.0	795.0	795.0
Próximo vencimiento de REDI el 20 de Setiembre del 2021	183.0	300.0	300.0	200.0	200.0
Vencimiento de REDI del 17 de setiembre 2021	483.0	300.0	300.0	0.0	600.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0 400.0 200.0	200.0 100.0 200.0	200.0 100.0 200.0	200.0 0.0 400.0	400.0 200.0
Propuestas recibidas	700.0 1500.0 600.0	800.0 1500.0 600.0	800.0 1100.0 600.0	800.0 1600.0	1200.0 600.0
Plazo de vencimiento	91 d 181 d 273 d	91 d 181 d 273 d	91 d 181 d 273 d	91 d 181 d	181 d 273 d
Tasas de interés: Mínima	1.30 1.66 1.80	1.31 1.69 1.76	1.33 1.67 1.75	1.30 1.61	1.65 1.81
Máxima	1.30 1.75 1.85	1.35 1.69 1.80	1.33 1.67 1.78	1.30 1.66	1.66 1.82
Promedio	1.30 1.70 1.83	1.33 1.69 1.78	1.33 1.67 1.76	1.30 1.64	1.66 1.81
Saldo	8,449.9	8,949.9	9,449.9	10,049.9	10,649.9
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 17 de setiembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
b. Liquid. Reoos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP. Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones Fuera de Mesa de Mesa de Negociación del BCR	595.3	299.7	1,010.6	411.5	476.9
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	145.0	73.0	246.0	100.0	116.0
Tipo de cambio promedio	4.1058	4.1049	4.1083	4.1145	4.1111
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	7.4	0.0	0.2	0.0	0.2
i. Compras (millones de US$)	7.4		0.2	0.0	0.2
ii. Ventas (millones de US$)					
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valoración)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3,954.1**	**3,561.8**	**3,195.0**	**3,113.2**	**3,371.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal directa de valores (Repo overnight)					
Contrato (tasa efectiva diaria)	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0037%	0.0045%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,503.7	1,813.2	1,817.5	1,696.5	2,482.1
Tasa de interés	0.85%	0.85%	0.85%	0.85%	0.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2,356.4**	**1,748.6**	**1,377.5**	**1,414.7**	**1,489.1**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,950.3	10,114.6	9,941.7	9,809.9	9,719.6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado requerido (millones de S/)	9,750.3	9,914.6	9,741.7	9,609.9	9,519.6
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,637.9	3,743.3	3,576.2	3,409.9	3,294.8
d. Coeficiente de encaje en moneda nacional (veces) (Meta 0.02 (*))	1.3	1.3	1.3	1.2	1.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	165.0	94.0	140.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	108.5	171.0	115.1	135.0	105.0
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, CDLBCRP, CDCRP y CTDV	0.0	0.0	14.0	0.0	0.0
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 24 meses (monto / tasa promedio)					
7. Activos internacionales de las empresas bancarias (millones de US$)	**Set 10, 2021**	**Set 13, 2021**	**Set 14, 2021**	**Set 15, 2021**	**Set 16, 2021**
Stock de la reserva oficial = a + b + c + d + e + f + g + h	96.9	98.9	99.1	98.8	99.4
Flujo de la posición contable = a + b.II - c.II + e + g	52.6	138.7	71.9	173.4	90.6
a. Mercado sect con el público	-55.3	9.6	6.7	-56.9	37.7
i. Compras	317.6	313.2	304.5	445.7	546.6
ii. (-) Ventas	372.9	303.5	297.8	502.5	508.9
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	170.9	-47.4	79.4	-8.7	-170.9
i. Pactadas	276.9	267.3	189.3	281.8	313.2
ii. (-) Vencidas	143.9	309.7	162.9	290.5	445.2
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	138.0	-31.0	76.0	153.6	-62.3
i. Pactadas	149.6	232.7	215.1	289.1	275.6
ii. (-) Vencidas	11.6	263.7	139.1	135.5	337.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	257.5	257.0	347.1	385.0	464.8
ii. A futuro	0.0	50.0	18.0	35.0	0.0
e. Operaciones sect asociadas a swaps v vencimientos de forwards sin entrega	-129.1	-41.3	-22.1	-164.3	-148.2
i. Compras	9.8	758.1	137.0	134.5	286.8
ii. (-) Ventas	138.9	799.5	159.3	298.8	434.9
f. Efecto de Opciones	2.3	-25.8	-0.3	-0.1	-0.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	151.0	-37.4	63.5	244.6	93.6
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.1092	4.1049	4.1021	4.1077	4.1123

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera