BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	25 Oct 21	26 Oct 21	27 Oct 21	28 Oct 21	29 Oct 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**15,781.1**	**15,602.0**	**15,560.5**	**16,344.4**	**15,925.6**
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	15.885.0	15.885.0	15.885.0	15.885.0	15.885.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 2 de Noviembre del 2021	357.6	357.6	357.6	357.6	357.6
Vencimiento de CD BCRP del 2 al 5 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	357.6
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4.113.3	4.113.3	4.113.3	4.373.3	4.383.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 2 de noviembre del 2021	0.9	0.9	0.9	60.0	70.0
Vencimiento de Repo Valores del 2 al 5 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	60.0	70.0
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 Repo de Cartera General del 2 al 5 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	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	5.012.4	5.012.4	5.012.4	5.412.4	5.412.4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 13 de Enero del 2022	1.6	1.6	1.6	1.6	1.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 2 al 5 de noviembre de 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 2 al 5 de noviembre de 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)		200.0			
Propuestas recibidas		200.0			
Plazo de vencimiento		94 d			
Márgen: Mínima		0.04			
Máxima		0.04			
Promedio		0.04			
Saldo	10284.9	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	110.0
Vencimientos de CDV BCRP del 2 al 5 de noviembre de 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 2 al 5 de noviembre de 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2.000.1 11.300.1	1.499.8 10.700.2	1.465.0 11.400.2	1.313.7 11.356.2	1.058.7 10.839.4
Propuestas recibidas	2.004.0 11.621.1	1.633.4 11.090.1	1.465.0 11.462.5	1.313.7 11.356.2	1.063.2 10.839.4
Plazo de vencimiento	8 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 4 d
Tasas de interés: Mínima	1.48 1.48	1.48 1.48	1.49 1.48	1.48 1.48	1.48 1.48
Máxima	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50	1.50 1.50
Promedio	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.49	1.50 1.50	1.50 1.49
Saldo	20.293.2	19.193.2	19.358.1	19.134.8	18.176.7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 2 de Noviembre del 2021	13.300.0	12.700.3	12.893.2	12.856.2	14.339.3
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 2 al 5 de noviembre de 2021	18.293.1	15.693.3	14.393.2	12.856.2	18.176.7
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4.512.3	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	1.000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 2 al 5 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 2 al 5 de noviembre de 2021					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2.646.0	2.646.0	2.646.0	2.646.0	2.646.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 2 de Noviembre del 2021	436.0	436.0	436.0	436.0	436.0
Vencimiento de CDR BCRP del 2 al 5 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	586.0
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 2 al 5 de noviembre de 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1.902.0	1.902.0	1.902.0	1.902.0	1.902.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 5 de Noviembre del 2021	30.0	30.0	30.0	30.0	30.0
Vencimiento de REPO del 2 al 5 de noviembre de 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	30.0
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 2 al 5 de noviembre de 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 2 al 5 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 Repo Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 2 al 5 de noviembre de 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	120.0 80.0 160.0	299.9 75.0	200.0 200.0 300.0 200.0	200.0 200.0 100.0	300.0 200.0 200.0 90.1
Propuestas recibidas	120.0 81.0 160.0	450.0 75.0	200.0 640.0 740.0 215.0	350.0 820.0 300.0	420.0 300.0 260.0 90.1
Plazo de vencimiento	273 d 273 d 273 d	273 d 273 d	273 d 273 d 273 d 273 d	271 d 271 d 271 d	276 d 276 d 276 d 276 d
Tasas de interés: Mínima	0.60 0.60 0.60	0.58 0.60	0.60 0.55 0.51 0.50	0.50 0.45 0.40	0.40 0.48 0.54 0.57
Máxima	0.60 0.60 0.60	0.60 0.60	0.60 0.55 0.53 0.60	0.50 0.45 0.40	0.58 0.54 0.60 0.60
Promedio	0.60 0.60 0.60	0.60 0.60	0.60 0.55 0.52 0.54	0.50 0.45 0.40	0.50 0.51 0.57 0.58
Saldo	33.853.8	34.228.7	34.627.7	34.887.7	34.704.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 2 de Noviembre del 2021	501.0	501.0	240.0	1.012.9	570.0
Vencimiento de SC - Venta del 2 al 5 de noviembre de 2021	1.753.9	1.753.9	1.252.9	1.012.9	2.345.5
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)		200.0		100.0	100.0
Propuestas recibidas		250.0		100.0	100.0
Plazo de vencimiento		14 d		14 d	14 d
Tasas de interés: Mínima		0.30		0.30	0.30
Máxima		0.30		0.30	0.30
Promedio		0.30		0.30	0.30
Saldo	600.0	600.0	600.0	500.0	600.0
Próximo vencimiento de RED el 4 de Noviembre del 2021	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de RED del 2 al 5 de noviembre de 2021	400.0	200.0	200.0	0.0	200.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100.0	100.0	100.0	100.0	200.0
Propuestas recibidas	200.0	200.0	200.0	150.0	400.0
Plazo de vencimiento	182 d	182 d	182 d	182 d	182 d
Tasas de interés: Mínima	2.02	2.02	2.03	2.03	2.07
Máxima	2.02	2.02	2.03	2.06	2.07
Promedio	2.02	2.02	2.03	2.04	2.07
Saldo	21.819.9	21.919.9	22.019.9	22.119.9	22.319.9
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 2 al 5 de noviembre de 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 cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	23.8	431.6	12.0	501.6	12.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	6.0	108.0	3.0	126.0	3.0
Tipo de cambio promedio	3.9740	3.9965	3.9880	3.9812	3.9920
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	-19.5	0.0	-10.0	-10.0	-5.4
i. Compras (millones de US$)	0.5	0.0	0.0	0.0	10.6
ii. Ventas (millones de US$)	20.0	0.0	10.0	10.0	16.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2.457.1**	**2.770.4**	**2.683.3**	**3.172.9**	**4.015.5**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0063%	0.0054%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasa de interés	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1.638.8	1.941.6	1.591.8	2.373.3	2.877.0
Tasa de interés	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%	1.35%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**818.3**	**828.8**	**1.091.5**	**799.6**	**1.138.5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9.230.4	9.134.3	9.043.2	8.981.2	8.897.2
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.7	4.6	4.6	4.5	4.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3.236.8	3.141.0	3.055.8	2.995.0	2.909.2
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.6	1.6	1.5	1.5	1.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	446.0	473.0	1.681.0	775.0	609.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50	1.50 / 1.50 / 1.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	105.0	60.0	115.0	265.0	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	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	13.8	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$)	**Oct.22. 2021**	**Oct.25. 2021**	**Oct.26. 2021**	**Oct.27. 2021**	**Oct.28. 2021**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	60.2	10.0	-16.8	-26.0	-6.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-68.4	-33.1	-125.8	-33.9	-51.6
a. Mercado spot con el público	-80.8	-34.1	-231.3	-21.1	-176.0
i. Compras	281.2	265.4	276.6	325.3	251.3
ii. (-) Ventas	362.0	299.5	507.9	346.5	427.3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	37.3	-12.1	85.9	-156.1	-66.0
i. Pactadas	170.1	390.2	269.5	237.3	307.0
ii. (-) Vencidas	132.8	402.3	183.7	393.4	373.0
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-37.7	-35.3	70.4	-62.7	-47.6
i. Pactadas	139.2	230.8	226.3	343.5	298.8
ii. (-) Vencidas	176.8	266.0	155.9	406.2	346.4
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	249.5	324.2	366.5	372.1	257.2
ii. A futuro	15.0	14.0	10.0	8.0	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	46.9	-136.8	-30.4	10.1	-27.6
i. Compras	169.0	250.0	149.5	401.2	341.5
ii. (-) Ventas	122.1	386.8	179.8	391.1	369.1
f. Efecto de Opciones	-0.5	0.2	-0.3	1.4	-0.3
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	63.6	21.3	202.0	89.9	189.3
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9638	3.9713	3.9930	3.9848	3.9775
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera