BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	20 Dic 21		21 Dic 21		22 Dic 21		23 Dic 21		24 Dic 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**16 289,5**		**15 008,2**		**13 678,4**		**11 752,6**		**10 959,7**
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	14 346.9		14 346.9		14 346.9		14 346.9		14 346.9
Próximo vencimiento de CD BCRP el 4 de Enero del 2022			2 185.0						2 185.0
Vencimiento de CD BCRP del 27 al 31 de Diciembre 2021			0.0						0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	5 813.3		5 813.3		5 813.3		5 963.3		5 963.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Enero del 2022			200.0						200.0
Vencimiento de Repo Valores del 27 al 31 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		0.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General			0.0						0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 27 al 31 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	6 443.4		6 443.4		6 443.4		6 443.4		6 443.4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 11 de Enero del 2022			1 6						1 6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 27 al 31 de Diciembre 2021			0.0						0.0
v. 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	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 27 al 31 de Diciembre 2021									
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	1000.0		700.0		700.1		220.0		
Propuestas recibidas	1927.0		1435.0		1095.0		235.0		
Plazo de vencimiento	95 d		94 d		98 d		95 d		
Márgen: Mínima	0.03		0.03		0.03		0.03		
Máxima	0.03		0.03		0.03		0.04		
Promedio	0.03		0.03		0.03		0.04		
Saldo	10734.6		11434.6		12134.7		12354.7		12354.7
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 28 de Diciembre del 2021			1290.0						1290.0
Vencimientos de CDV BCRP del 27 al 31 de Diciembre 2021			0.0						1290.0
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 27 al 31 de Diciembre 2021									
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 000.0	10 399.8	1 199.9	9 300.0	1 500.0	8 099.9	746.0	6 999.9	6 772.9
Propuestas recibidas	1 319.5	10 647.3	1 421.0	9 605.5	1 517.5	8 307.0	746.0	7 714.0	6 772.9
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	2.48	1.90	2.48	2.45	2.47	2.45	2.47	2.47	2.48
Máxima	2.50	2.50	2.50	2.50	2.50	2.50	2.50	2.50	2.50
Promedio	2.50	2.47	2.50	2.48	2.50	2.48	2.50	2.49	2.48
Saldo	17 118.9		15 718.9		14 518.9		12 945.9		11 218.8
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 27 de Diciembre del 2021			10 799.9						7 772.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 27 al 31 de Diciembre 2021			13 519.0						11 218.8
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (CDLOCTP)									
Propuestas recibidas									
Plazo de vencimiento									
Tasas de interés: Mínima									
Máxima									
Promedio									
Saldo	4 632.3		4 632.3		4 632.3		4 632.3		4 632.3
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Febrero del 2022			1 000.0						1 000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 27 al 31 de Diciembre 2021			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 27 al 31 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 30 de Diciembre del 2021			200.0						200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 27 al 31 de Diciembre 2021			0.0						200.0
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 27 al 31 de Diciembre 2021									
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	200.0								
Propuestas recibidas	300.0								
Plazo de vencimiento	31 d								
Tasas de interés: Mínima	2.80								
Máxima	2.98								
Promedio	2.86								
Saldo	9 949.1		9 949.1		9 949.1		9 949.1		9 949.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 3 de Enero del 2022			100.0						100.0
Vencimiento de REPO del 27 al 31 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 Reso									
Vencimiento de REPO del 27 al 31 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 Expansion									
Vencimiento de REPO Expansión del 27 al 31 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 Sustitución									
Vencimiento de REPO Sustitución del 27 al 31 de Diciembre 2021									
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0	200.0					200.0		
Propuestas recibidas	545.0	265.0					220.0		
Plazo de vencimiento	183 d	274 d					85 d		
Tasas de interés: Mínima	0.49	0.52					0.52		
Máxima	0.54	0.57					0.54		
Promedio	0.50	0.56					0.53		
Saldo	37 944.2		37 944.2		37 570.2		37 550.2		37 550.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 30 de Diciembre del 2021			374.0						600.0
Vencimiento de SC - Venta del 27 al 31 de Diciembre 2021			594.0						600.0
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)			100.0						
Propuestas recibidas			100.0						
Plazo de vencimiento			14 d						
Tasas de interés: Mínima			0.30						
Máxima			0.30						
Promedio			0.30						
Saldo	300.0		280.0		280.0		160.0		160.0
Próximo vencimiento de RED el 30 de Diciembre del 2021			120.0						60.0
Vencimiento de RED del 27 al 31 de Diciembre 2021			120.0						60.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0		50.0						
Propuestas recibidas	100.0		100.0						
Plazo de vencimiento	60 d		183 d						
Tasas de interés: Mínima	2.78		3.05						
Máxima	2.78		3.07						
Promedio	2.78		3.05						
Saldo	20 919.9		20 969.9		20 769.9		20 569.9		20 369.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 27 de Diciembre del 2021			200.0						100.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 27 al 31 de Diciembre 2021			600.0						400.0
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	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000		0.0000		0.0000		0.0000		0.0000
ii. Ventas (millones de US$)									
Tipo de cambio promedio									
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	4.0		5.3		0.6		-23.0		0.0
i. Compras (millones de US$)	4.0		5.3		0.6		0.0		0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		23.0		0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR									
ii. Compras de BTP (valor nominal)									
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 089.7**		**3 808.3**		**3 378.4**		**3 786.7**		**4 186.8**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones									
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)									
Propuestas recibidas (fuera de mercado)	0.0000%		0.0000%		0.0000%		0.0000%		0.0000%
b. Compra temporal de valores (Repo de valores)									
Tasa de interés	3.00%		3.00%		3.00%		3.00%		3.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional									
Tasa de interés									
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	2 644.2		1 904.3		1 786.3		2 760.0		2 678.5
Tasa de interés	0.25%		0.25%		0.25%		0.25%		0.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 445.5**		**1 904.3**		**1 592.1**		**1 026.7**		**1 508.3**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10 993.3		10 855.3		10 756.5		10 647.8		10 496.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.6		5.5		5.5		5.4		5.4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	4 408.5		4 267.4		4 166.6		4 054.7		3 903.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2.3		2.2		2.1		2.1		2.0
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP									
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	95.0		575.0		230.0		65.0		100.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	2.50 / 2.50 / 2.50		2.50 / 2.50 / 2.50		2.50 / 2.50 / 2.50		2.50 / 2.50 / 2.50		2.50 / 2.50 / 2.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio									
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	30.0		23.0		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 entrenesas bancarias (millones de US$)	**Dic. 17, 2021**		**Dic. 20, 2021**		**Dic. 21, 2021**		**Dic. 22, 2021**		**Dic. 23, 2021**
Flujo de la posición diaria: = a + b + c - d + e + f + g	66.3		2.3		47.8		-16.1		-16.7
Flujo de la posición contable: = a + b.1 - c.1 + e + g	136.9		106.6		116.0		14.9		-160.0
a. Mercado spot con el público	212.3		82.3		116.5		8.0		-158.5
i. Compras	479.1		469.3		427.6		443.2		338.0
ii. (-) Ventas	266.8		387.0		311.1		435.3		496.6
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	146.9		-247.4		82.0		165.1		-18.0
i. Pactadas	257.1		165.4		163.5		485.6		135.5
ii. (-) Vencidas	110.2		412.8		81.5		320.8		153.4
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	241.6		-70.9		170.4		98.8		-164.4
i. Pactadas	371.0		471.3		227.9		340.5		252.4
ii. (-) Vencidas	129.4		542.2		57.5		241.7		416.8
d.. Operaciones cambiarias interbancarias									
i. Al contado	221.6		304.9		457.4		431.6		267.8
ii. A futuro	40.0		39.0		29.0		51.0		13.0
e. Operaciones sonó asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-5.1		155.3		-23.7		-71.1		263.9
i. Compras	103.5		535.6		56.2		240.2		404.4
ii. (-) Ventas	108.6		380.3		80.0		311.2		140.4
f. Efecto de Opciones	19.3		0.1		0.0		-1.8		0.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-52.3		70.5		-0.8		-96.5		-5.8
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera									
Tasa de interés									
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0361		4.0453		4.0540		4.0479		4.0126
(*) Datos preliminares.									

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera