BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	27 Dic 21	28 Dic 21	29 Dic 21	30 Dic 21	31 Dic 21
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**14,289.8**	**15,142.7**	**15,044.1**	**14,572.5**	**12,381.8**
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
Próximos vencimientos de CD BCRP el 4 de Enero del 2022	7,196.0	7,196.0	7,196.0	7,196.0	7,196.0
Vencimiento de CD BCRP del 31 de Diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	2,264.5
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,963.3	5,963.3	5,963.3	5,963.3	5,963.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 3 de Enero del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de Repo Valores del 31 de Diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	600.0
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 31 de Diciembre 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	6,442.0	6,442.0	6,442.0	6,442.0	6,442.0
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 13 de Enero del 2022	1.6	1.6	1.6	1.6	1.6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 31 de Diciembre 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)					
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 31 de Diciembre 2021					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	200.0	699.9	500.0	199.8	
Propuestas recibidas	600.0	1,505.0	795.0	967.0	
Plazo de vencimiento	91 d	90 d	96 d	95 d	
Mínimo: Mínima	0.03	0.03	0.03	0.03	
Máxima	0.03	0.03	0.04	0.04	
Promedio	0.03	0.03	0.03	0.04	
Saldo	17,664.7	17,964.6	17,864.6	17,664.4	17,464.4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Enero del 2022	1,298.0	750.0	750.0	750.0	750.0
Vencimientos de CDV BCRP del 31 de Diciembre 2021	1,298.0	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 31 de Diciembre 2021					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,199.9 8,507.5	1,000.0 9,947.8	1,200.1 9,817.9	1,309.5 9,725.9	6,910.8
Propuestas recibidas	1,352.2 8,507.5	1,250.0 9,947.8	1,565.0 9,817.9	1,309.5 9,725.9	6,910.8
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	7.48 7.47	7.48 7.47	7.47 7.47	7.47 7.47	7.47
Máxima	2.50 2.50	2.50 2.50	2.50 2.50	2.50 2.50	2.50
Promedio	2.50 2.48	2.50 2.49	2.50 2.49	2.50 2.49	2.49
Saldo	13,153.3	14,393.7	13,963.9	14,435.4	11,620.3
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo al 31 de Diciembre del 2021	8,707.4	11,447.8	10,563.9	9,725.9	8,110.7
Vencimientos de Depósitos a Plazo del 31 de Diciembre 2021	11,953.4	12,593.8	10,563.9	9,725.9	11,620.3
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,632.3	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	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 31 de Diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro 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 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	1,190.0	1,190.0	1,190.0	1,190.0	1,190.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 2 de Enero del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimientos de CDR BCRP del 31 de Diciembre 2021	200.0	200.0	200.0	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 31 de Diciembre 2021					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			100.0		
Propuestas recibidas			148.0		
Plazo de vencimiento			30 d		
Tasas de interés: Mínima			2.80		
Máxima			3.05		
Promedio			3.05		
Saldo	3,242.1	3,242.1	3,342.1	3,342.1	3,342.1
Próximos vencimientos de Repo Dólares el 7 de Enero del 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de REPO del 31 de Diciembre 2021	0.0	0.0	0.0	0.0	300.1
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 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 Repo Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 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 31 de Diciembre 2021					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP		55.0	140.0 200.0 200.0	25.0 72.0 135.0	
Propuestas recibidas		55.0	140.0 245.0 295.0	25.0 72.0 135.0	
Plazo de vencimiento		274 d	183 d 274 d 274 d	274 d 183 d 95 d	
Tasas de interés: Mínima		0.59	0.56 0.56 0.52	0.55 0.51 0.54	
Máxima		0.59	0.56 0.56 0.59	0.55 0.55 0.55	
Promedio		0.59	0.56 0.56 0.55	0.55 0.55 0.55	
Saldo	37,550.2	37,605.2	38,145.2	37,777.2	37,777.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 3 de Enero del 2022	600.0	600.0	600.0	168.0	168.0
Vencimiento de SC - Venta del 31 de Diciembre 2021	600.0	600.0	600.0	0.0	568.0
xx. Subasta de Repo de Valores para crossear dólares (REDI)				50.0	
Propuestas recibidas				50.0	
Plazo de vencimiento				14 d	
Tasas de interés: Mínima				0.30	
Máxima				0.30	
Promedio				0.30	
Saldo	160.0	160.0	160.0	160.0	150.0
Próximo vencimiento de REDI el 4 de Enero del 2022	60.0	60.0	60.0	100.0	100.0
Vencimiento de REDI del 31 de Diciembre 2021	60.0	60.0	60.0	0.0	100.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0	25.0			
Propuestas recibidas	50.0	75.0			
Plazo de vencimiento	90 d	182 d			
Tasas de interés: Mínima	2.81	3.05			
Máxima	2.81	3.08			
Promedio	2.81	3.06			
Saldo	20,319.9	20,244.9	20,144.9	20,044.9	20,044.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 4 de Enero del 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 31 de Diciembre 2021	300.0	200.0	100.0	0.0	200.0
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0021-2020-BCRP)					
c. Operaciones Interbancarias en Moneda Extranjera (swaps)	0.0	0.0	4.0	283.2	20.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	
ii. Ventas (millones de US$)			1.0	71.0	5.0
Tipo de cambio promedio			3.9800	3.9883	3.9920
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	-150.1	-32.8	-64.0	-52.0
i. Compras (millones de US$)	0.0	3.3	10.4	1.0	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	153.4	43.0	65.0	52.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,592.4**	**3,495.0**	**3,622.1**	**3,054.1**	**5,451.0**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de valores (Repo de valores) (swap)					
Tasa de interés: Comodín (tasa efectiva diaria)	0.0088%	0.0089%	0.0089%	0.0088%	0.0080%
b. Compra temporal directa de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	3,045.5	2,722.7	2,989.8	2,329.0	2,987.6
Tasa de interés	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,256.9**	**772.3**	**632.3**	**725.1**	**2,463.4**
a. Fondo de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,250.5	10,154.2	10,027.7	9,935.6	9,852.1
b. Fondo de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.00	5.00	5.00	5.00	5.00
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,655.6	3,511.0	3,448.1	3,349.6	3,267.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.8	1.8	1.8	1.7	1.7
6. Mercado Interbancario y mercado sucursales de FINDETE					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	0.0	0.0	0.0	0.0	30.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	2.50 / 2.50 / 2.50	2.50 / 2.50 / 2.50	2.50 / 2.50 / 2.50	2.50 / 2.50 / 2.50	2.50 / 2.50 / 2.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
c. Total operaciones sucursales de FINDETER, FINDECOOP y CTV	4.0	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 Interbancarias en Moneda Extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Dic. 24, 2021**	**Dic. 27, 2021**	**Dic. 28, 2021**	**Dic. 29, 2021**	**Dic. 30, 2021**
Saldo de la posición contable al inicio del día = a + b + c	245.7	317.4	160.5	99.4	-170.5
Flujo de la posición contable = a + b + c = d + e + f	-56.8	-82.6	-109.3	-112.0	-115.2
a. Mercado spot con el público	-56.2	-126.0	-144.1	-109.3	-76.6
i. Compras	72.8	274.1	359.2	284.7	362.4
ii. (-) Ventas	129.0	400.2	473.4	394.0	439.0
b. Operaciones forward o swap al público (con y sin entrega)	11.6	-91.7	196.6	194.8	-79.5
i. Partidas	34.9	245.9	218.9	519.9	285.8
ii. (-) Vencidas	23.3	337.1	22.3	325.2	365.3
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	10.6	-162.4	-1.5	195.3	-164.1
i. Partidas	46.2	186.2	132.8	563.7	216.4
ii. (-) Vencidas	35.6	348.6	134.3	368.4	380.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al Contado	31.0	225.3	505.9	276.8	265.3
ii. A futuro	0.0	20.0	20.0	45.0	10.0
e. Operaciones sobl asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	12.1	57.8	118.0	81.4	-61.0
i. Compras	54.7	341.4	175.4	398.5	307.8
ii. (-) Ventas	22.6	283.6	5.3	335.5	343.8
f. Efecto de Opciones	0.2	0.0	-0.4	0.2	0.2
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.4	-2.9	12.8	135.1	-71.2
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	4.0060	3.9846	3.9497	3.9699	3.9849

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera