BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	24 Ene 22	25 Ene 22	26 Ene 22	27 Ene 22	28 Ene 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10,473.6**	**10,628.5**	**10,485.8**	**12,453.6**	**11,865.5**
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	11,886.1	11,886.1	11,886.1	9,846.1	9,846.1
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Febrero del 2022	2,040.0	2,040.0	2,040.0	2,110.0	2,110.0
Vencimiento de CD BCRP del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	2,040.0	2,040.0	2,040.0	0.0	0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,463.3	5,463.3	5,463.3	5,462.4	5,362.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de Abril del 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Repo Valores del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	100.9	100.9	100.9	100.0	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	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	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	6,437.5	6,437.5	6,436.5	6,436.5	6,436.5
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 1 de Febrero del 2022	1.5	1.5	1.5	1.5	1.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	1.5
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 31 de Enero al 04 de Febrero 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)			300.0	300.1	300.0
Propuestas recibidas			400.0	494.0	350.0
Plazo de vencimiento			69.d	84.d	87.d
Mínima			0.03	0.04	0.04
Máxima			0.04	0.04	0.04
Promedio			0.04	0.04	0.04
Saldo	15,714.3	15,714.3	16,014.3	16,314.4	16,414.4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de Febrero del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	1,488.8
Vencimiento de CDV BCRP del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	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 Enero al 04 de Febrero 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2,555.0 6,600.0	2,755.0 6,755.0	2,014.5 6,600.0	1,755.1 7,464.2	1,755.0 7,595.9
Propuestas recibidas	2,151.0 7,350.7	2,734.5 7,018.5	2,014.5 6,091.1	1,675.0 7,464.2	1,296.8 7,595.9
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	2.92 2.80	2.95 2.75	2.95 2.75	2.95 2.75	2.97 2.75
Máxima	3.00 2.90	3.00 2.90	3.00 2.89	3.00 3.00	3.00 3.00
Promedio	2.99 2.81	2.99 2.81	3.00 2.88	2.99 2.81	2.99 2.79
Saldo	13,908.8	14,607.3	14,021.8	15,151.1	15,510.5
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 31 de Enero del 2022	8,001.5	6,400.0	7,535.0	8,436.5	9,095.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	12,458.8	11,107.3	8,507.3	8,436.5	15,510.5
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,633.3	4,633.3	4,633.3	4,633.3	4,633.3
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 Enero al 04 de Febrero 2022	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					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Colocbn					
Vencimiento de Colocbn del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 26 de Febrero del 2022	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de CDR BCRP del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
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 31 de Enero al 04 de Febrero 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Swap)					
Propuestas recibidas				350.0	80.0
Plazo de vencimiento				530.0	80.0
Tasas de interés: Mínima				7.d	3.d
Máxima				3.50	3.20
Promedio				3.70	3.40
Saldo	2,641.9	2,641.9	2,641.9	2,641.9	2,821.9
Próximo vencimiento de Swap Dólar el 11 de Enero del 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	80.0
Vencimiento de REPO del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	610.0
xvi. Subasta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022					
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 31 de Enero al 04 de Febrero 2022					
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 Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	199.9 200.0				
Propuestas recibidas	355.0 490.0				
Plazo de vencimiento	91.d 182.d				
Tasas de interés: Mínima	0.60 0.55				
Máxima	0.60 0.57				
Promedio	0.60 0.56				
Saldo	38,734.1	38,734.1	38,734.1	38,734.1	38,734.1
Próximo vencimiento de SC- Venta del 18 de Marzo del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC- Venta del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	100.0	100.0	100.0	50.0	50.0
Próximo vencimiento de RED el 1 de Febrero del 2022	50.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de RED del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	50.0	50.0	50.0	0.0	50.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0	50.0			50.0
Propuestas recibidas	190.0	190.0			190.0
Plazo de vencimiento	90.d	181.d			273.d
Tasas de interés: Mínima	3.39	3.80			3.95
Máxima	3.39	3.80			3.95
Promedio	3.39	3.80			3.95
Saldo	19,969.9	20,019.9	20,019.9	20,019.9	20,069.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 24 de Febrero del 2022	300.0	300.0	300.0	300.0	300.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 31 de Enero al 04 de Febrero 2022	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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tasa de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)					
Tasa de cambio promedio					
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	6.5	0.7	0.0	6.5	0.2
i. Compras (millones de US$)	6.5	0.7	0.0	6.5	0.2
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2,598.6**	**2,028.5**	**2,471.3**	**3,589.2**	**2,849.6**
4. Operaciones monetarias del BCR tras el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Comisión tasa efectiva diaria	0.0092%	0.0091%	0.0092%	0.0092%	0.0100%
b. Compra temporal de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.50%	3.50%	3.50%	3.50%	3.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	686.5	1,029.2	1,180.0	1,207.9	1,437.9
Tasa de interés	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1,922.1**	**999.3**	**1,291.3**	**2,381.3**	**1,411.7**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10,507.6	10,455.3	10,318.0	10,241.0	10,241.3
b. Encaje de exceso en moneda nacional promedio acumulado (%) del TOSEL (*)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,786.8	3,735.0	3,598.2	3,523.5	3,521.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSEL) (*)	2.0	1.9	1.9	1.8	1.8
6. Operaciones de reporte de moneda nacional del mercado de COBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	790.0	978.0	732.0	717.0	318.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIOR	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00	3.00 / 3.00 / 3.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					
c. Total mercado secundario de COBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	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 en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**Ene. 21, 2022**	**Ene. 24, 2022**	**Ene. 25, 2022**	**Ene. 26, 2022**	**Ene. 27, 2022**
Flujo de la posición contable = a + b + c + d + e + f + g + h	-17.7	48.0	5.8	53.5	-19.9
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	74.0	23.7	-1.6	-164.6	-133.6
a. Mercado spot con el público	59.9	42.6	-10.9	-153.8	-131.3
i. Compras	340.0	425.5	490.8	270.2	388.1
ii. (-) Ventas	280.1	382.9	501.6	424.0	519.3
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	12.4	57.6	2.7	187.3	92.3
i. Pactadas	78.0	114.6	203.3	265.5	544.9
ii. (-) Vencidas	65.6	57.0	200.7	78.2	452.6
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	103.1	85.2	-3.0	-9.2	-22.0
i. Pactadas	235.7	241.2	215.8	78.6	305.5
ii. (-) Vencidas	132.6	156.1	218.9	87.8	327.5
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	176.1	298.6	260.6	444.7	493.0
ii. A futuro	20.0	5.0	66.0	36.0	47.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	83.7	82.1	28.3	3.4	-126.4
i. Compras	122.8	135.9	215.0	78.6	317.6
ii. (-) Ventas	39.0	53.8	186.7	75.3	444.0
f. Efecto de Opciones	-1.0	-1.3	-0.3	0.5	0.4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-2.7	51.2	-0.9	-4.5	-1.1
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8248	3.8397	3.8488	3.8464	3.8359

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera