BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	07 Feb 22	08 Feb 22	09 Feb 22	10 Feb 22	11 Feb 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**14,432.6**	**15,136.9**	**17,184.4**	**18,121.9**	**23,563.9**
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)					499.9
Propuestas recibidas					787.1
Plazo de vencimiento					35 d
Tasas de interés: Mínima					3.20
Máxima					3.49
Promedio					3.47
Saldo	9.846.1	9.846.1	9.846.1	9.846.1	10.596.0
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Febrero del 2022	2.110.0	2.110.0	2.110.0	2.110.0	2.110.0
Vencimiento de CD BCRP del 14 al 18 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	5.558.2
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5.362.4	5.362.4	5.362.4	5.362.4	5.362.4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 18 de Abril del 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de Repo Valores del 14 al 18 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	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	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 14 al 18 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	6.434.6	6.434.6	6.434.6	6.434.6	6.434.6
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 25 de Febrero del 2022	3.9	3.9	3.9	3.9	3.9
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 14 al 18 de Febrero 2022	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 14 al 18 de Febrero 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	150.0				200.0
Propuestas recibidas	150.0				330.0
Plazo de vencimiento	91 d				87 d
Márgen: Mínima	0.04				0.03
Máxima	0.04				0.03
Promedio	0.04				0.03
Saldo	16.764.4	16.764.4	16.764.4	16.764.4	16.964.4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 18 de Febrero del 2022	1.489.8	1.489.8	1.489.8	1.489.8	1.489.8
Vencimientos de CDV BCRP del 14 al 18 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	1489.8
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 14 al 18 de Febrero 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	7.261.1	9.094.0	10.744.4	12.800.0	2.500.0 13.031.7
Propuestas recibidas	7.261.1	9.094.0	10.744.4	12.972.3	4.436.5 13.031.7
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	2.78	2.83	2.80	2.83	3.20 3.00
Máxima	3.00	3.00	3.00	3.00	3.50 3.50
Promedio	2.94	2.95	2.97	2.97	3.49 3.45
Saldo	12.671.6	13.004.6	12.855.0	13.972.6	15.531.7
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 11 de Febrero del 2022	8.761.0	10.894.0	11.682.4	13.972.6	13.031.7
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 14 al 18 de Febrero 2022	12.671.6	13.004.6	12.855.0	13.972.6	15.531.7
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4.632.3	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 14 al 18 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					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Coloc-BN					
Vencimiento de Coloc - BN del 14 al 18 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	1.400.0	1.400.0	1.400.0	1.400.0	1.400.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 28 de Febrero del 2022	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de CDR BCRP del 14 al 18 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					
Vencimientos de CD BCRP del 14 al 18 de Febrero 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2.711.9	2.411.9	2.411.9	2.282.0	2.282.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 14 de Febrero del 2022	300.0	129.9	129.9	200.0	200.0
Vencimiento de REPO del 14 al 18 de Febrero 2022	429.9	129.9	129.9	0.0	230.0
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 14 al 18 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 14 al 18 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 Repo Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 14 al 18 de Febrero 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	39.694.1	39.694.1	39.694.1	39.694.1	39.694.1
Próximo vencimiento de SC-Venta el 18 de Marzo del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de SC - Venta del 14 al 18 de Febrero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	11.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de RED el 11 de Febrero del 2022	11.0				
Vencimiento de RED del 14 al 18 de Febrero 2022	11.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0	50.0		50.0	25.0
Propuestas recibidas	200.0	250.0		250.0	100.0
Plazo de vencimiento	89 d	181 d		181 d	273 d
Tasas de interés: Mínima	3.68	4.18		4.18	4.28
Máxima	3.70	4.20		4.20	4.28
Promedio	3.69	4.19		4.19	4.28
Saldo	20.269.9	20.319.9	20.319.9	20.319.9	20.344.9
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 14 al 18 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$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.1	0.0	0.3	0.8	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.1	0.0	0.3	0.8	0.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**7.021.5**	**6.042.9**	**6.440.0**	**5.321.9**	**7.082.3**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0092%	0.0092%	0.0092%	0.0094%	0.0111%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.50%	3.50%	3.50%	3.50%	4.00%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	362.6	348.9	336.4	901.7	2.100.9
Tasa de interés	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%	2.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**6.658.9**	**5.694.0**	**6.103.6**	**4.420.2**	**4.981.4**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14.734.5	14.378.9	14.066.6	14.006.7	13.598.7
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.7	7.5	7.3	7.3	7.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7.873.5	7.521.3	7.211.1	7.141.3	6.740.9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	4.1	3.9	3.8	3.7	3.5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	406.0	481.0	536.0	551.0	770.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	3.00 / 3.05/ 3.00	3.00 / 3.05/ 3.00	3.00 / 3.05/ 3.00	3.00 / 3.05/ 3.00	3.50 / 3.50/ 3.50
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	160.0	151.0	205.0	200.0	248.0
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	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$)	**Feb.04, 2022**	**Feb.07, 2022**	**Feb.08, 2022**	**Feb.09, 2022**	**Feb.10, 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	15.6	-105.7	-8.8	125.4	-92.4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-99.0	-51.8	-27.3	46.1	-196.3
a. Mercado spot con el público	29.2	-38.1	-18.3	53.0	-186.4
i. Compras	344.8	326.4	276.2	348.2	292.0
ii. (-) Ventas	315.6	364.6	294.5	295.1	478.4
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	152.6	129.8	208.4	161.4	-67.0
i. Pactadas	208.8	194.4	474.2	351.9	248.4
ii. (-) Vencidas	56.1	64.6	265.8	190.5	315.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	106.8	187.7	190.8	82.1	-170.3
i. Pactadas	339.3	291.9	445.9	289.6	364.6
ii. (-) Vencidas	232.5	104.2	255.1	207.5	534.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	540.5	198.3	259.2	368.2	268.7
ii. A futuro	30.0	2.5	30.0	74.5	0.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	53.9	29.4	-18.2	15.3	214.0
i. Compras	106.8	91.2	245.6	200.9	524.1
ii. (-) Ventas	52.9	61.7	263.8	185.7	310.2
f. Efecto de Opciones	1.6	4.0	0.9	0.1	0.6
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	61.4	-3.5	-1.5	-5.2	-4.4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.8720	3.8398	3.8409	3.8235	3.7521
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera