BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	14 Feb 22		15 Feb 22		16 Feb 22		17 Feb 22		18 Feb 22	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**21,242.2**		**17,714.9**		**13,888.0**		**15,630.8**		**15,857.7**	
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)	700.0		400.0		200.0		650.2		100.0	
Propuestas recibidas	917.0		497.5		219.8		650.2		115.9	
Plazo de vencimiento	32 d		31 d		33 d		32 d		31 d	
Tasas de interés: Mínima	3.40		3.40		3.47		3.47		3.48	
Máxima	3.48		3.48		3.48		3.48		3.48	
Promedio	3.48		3.48		3.48		3.48		3.48	
Saldo	9,435.0		9,987.9		10,310.4		6,022.4		8,172.4	
Vencimiento de CD BCRP el 21 de Febrero del 2022	3,448.2		3,448.2		3,448.2		1,895.0		1,895.0	
Vencimiento de CD BCRP el 18 de Febrero de 2022	3,448.2		3,448.2		3,448.2		0.0		2,049.0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (SBTP)										
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 Reso de Valores el 18 de Abril del 2022	500.0		500.0		500.0		500.0		500.0	
Vencimiento de Reso Valores el 18 de Febrero de 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 Reso de Cartera General	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
Vencimiento de Reso de Cartera General el 18 de Febrero de 2022	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	6,432.3		6,432.3		6,432.3		6,432.3		6,432.3	
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 25 de Febrero del 2022	3.9		3.9		3.9		3.9		3.9	
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 18 de Febrero de 2022	0.0		0.0		0.0		0.0		3.9	
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 adeudado	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 adeudado	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 Reso Especial - CDR el 18 de Febrero de 2022										
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	500.0		600.0		308.0		600.0		1000.0	
Propuestas recibidas	770.0		715.0		508.0		1080.0		1601.0	
Plazo de vencimiento	93 d		92 d		91 d		90 d		94 d	
Mínima	0.05		0.04		0.04		0.04		0.04	
Máxima	0.04		0.04		0.04		0.04		0.04	
Promedio	0.04		0.04		0.04		0.04		0.04	
Saldo	17,464.4		18,064.4		18,372.4		18,972.4		18,482.6	
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 25 de Febrero del 2022	1,489.8		1,489.8		1,489.8		1,489.8		1,719.8	
Vencimiento de CDV BCRP el 18 de Febrero de 2022	1,489.8		1,489.8		1,489.8		1,489.8		1,719.8	
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 el 18 de Febrero de 2022										
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1,988.9	13,700.0	2,700.0	10,450.0	576.5	9,900.0	1,700.0	10,700.1	2,500.0	9,800.1
Propuestas recibidas	2,799.0	15,317.3	3,516.0	11,964.7	576.5	11,210.6	1,567.0	11,100.4	3,666.0	10,662.0
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	3.40	3.30	3.40	3.35	3.40	2.41	3.40	3.33	3.40	3.24
Máxima	3.50	3.50	3.50	3.46	3.50	3.42	3.50	3.38	3.50	3.36
Promedio	3.50	3.41	3.50	3.38	3.49	3.38	3.49	3.36	3.49	3.34
Saldo	17,599.9		17,799.9		17,676.4		19,176.5		18,776.5	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Febrero del 2022	13,100.0		10,600.0		9,900.0		12,700.1		11,800.0	
Vencimiento de Depósitos a Plazo el 18 de Febrero de 2022	15,600.0		23,000.0		12,400.0		12,700.1		18,776.5	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	4,637.3		4,637.3		4,637.3		4,637.3		4,637.3	
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 el 18 de Febrero de 2022	0.0		0.0		0.0		0.0		1,000.0	
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 Colocr-BN										
Vencimiento de Colocr - BN el 18 de Febrero de 2022										
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)										
b. 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 el 18 de Febrero de 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 el 18 de Febrero de 2022										
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Swap)										
Propuestas recibidas										
Plazo de vencimiento										
Tasas de interés: Mínima										
Máxima										
Promedio										
Saldo	2,082.0		2,082.0		2,082.0		2,052.0		2,052.0	
Próximo vencimiento de Swap Cambiario el 4 de Marzo del 2022	30.0		30.0		30.0		230.0		230.0	
Vencimiento de REPO el 18 de Febrero de 2022	30.0		30.0		30.0		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 el 18 de Febrero de 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 el 18 de Febrero de 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 el 18 de Febrero de 2022										
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.1	200.0	200.0						200.0	
Propuestas recibidas	350.0	265.0	310.0						575.5	
Plazo de vencimiento	88 d	182 d	181 d						181 d	
Tasas de interés: Mínima	0.45	0.43	0.50						0.00	
Máxima	0.60	0.57	0.53						0.10	
Promedio	0.54	0.47	0.52						0.00	
Saldo	40,094.2		40,394.2		40,294.2		40,294.2		40,494.2	
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 el 18 de Febrero de 2022	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
xx. Subasta de Reso de Valores para ofrecer dólares (RSD)										
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 RSD el 18 de Febrero del 2022			0.0							
Vencimiento de RSD el 18 de Febrero de 2022	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	50.0		50.0						50.0	
Propuestas recibidas	100.0		150.0						150.0	
Plazo de vencimiento	89 d		181 d						273 d	
Tasas de interés: Mínima	3.94		4.22						4.37	
Máxima	3.98		4.22						4.50	
Promedio	3.96		4.22						4.44	
Saldo	20,394.9		20,444.9		20,444.9		20,444.9		20,494.9	
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 el 18 de Febrero de 2022	0.0		0.0		0.0		0.0		899.9	
b. Liquid. Repos Cartera de Créditos (Circular 0014-2020-BCRP, Circular 0017-2020-BCRP y Circular 0025-2020-BCRP)										
c. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0		0.0		0.0		0.0		-52.5	
i. Compras (millones de US$)										
Tipo de cambio promedio										
ii. Ventas (millones de US$)									14.0	
Tipo de cambio promedio									3.7500	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0		0.9		0.9		0.3		-0.4	
i. Compras (millones de US$)	0.0		0.9		0.0		0.3		0.4	
ii. Ventas (millones de US$)	0.0		0.0		0.0		0.0		0.0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP										
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR										
ii. Compras de BTP (Valorizado)										
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4,942.3**		**3,282.5**		**2,781.0**		**2,670.5**		**2,460.1**	
4. Operaciones monetarias del BCR tras el cierre de operaciones										
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)										
Corrección tasa efectiva diaria	0.0111%		0.0119%		0.0120%		0.0121%		0.0121%	
b. Compra temporal de valores (Repos de subasta)										
Tasa de interés	4.00%		4.00%		4.00%		4.00%		4.00%	
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional										
Tasa de interés										
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,216.9		1,790.0		1,259.7		925.3		1,521.5	
Tasa de interés	2.25%		2.25%		2.25%		2.25%		2.25%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**3,725.4**		**1,472.0**		**1,521.3**		**1,745.2**		**938.6**	
a. Fondo de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13,261.5		13,000.0		12,565.1		12,321.0		12,125.4	
b. Encaje de exceso en moneda nacional promedio acumulado (%) del TPMN (*)	n.o.		n.o.		n.o.		n.o.		n.o.	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6,403.9		6,141.6		5,709.0		5,465.5		5,271.3	
d. Exceso corriente en moneda nacional acumulado (% del TOSE) (*)	3.3		-3.2		3.0		2.8		2.7	
6. Cuentas corrientes de las empresas bancarias con el COBCRP										
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	770.0		759.0		515.0		277.0		885.0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	3.50 / 3.50 / 3.50		3.49 / 3.50 / 3.50		3.49 / 3.50 / 3.50		3.49 / 3.50 / 3.50		3.49 / 3.50 / 3.50	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	275.0		325.0		188.5		253.5		136.0	
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 COBCRP: COBCRP-NR v CDV	0.0		0.0		40.0		2.4		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.11, 2022**		**Feb.14, 2022**		**Feb.15, 2022**		**Feb.16, 2022**		**Feb.17, 2022**	
Posición de la posición global	-87.5		-87.5		-199.4		97.7		-38.1	
Flujo de la posición contable	93.2		-143.9		-200.4		37.7		-95.6	
a. Mercado spot con el público	92.5		-117.5		-208.3		39.4		-88.9	
i. Compras	415.1		568.1		461.0		373.1		361.6	
ii. (-) Ventas	322.6		685.6		669.3		333.7		450.4	
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	-44.2		36.5		-126.6		248.0		-174.6	
i. Pactadas	135.8		287.5		257.9		480.2		478.4	
ii. (-) Vencidas	180.0		251.1		384.5		232.2		653.0	
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	113.8		41.9		-135.0		188.1		-232.1	
i. Pactadas	232.2		250.3		173.4		497.1		283.2	
ii. (-) Vencidas	118.4		208.4		308.3		309.0		515.4	
d. Operaciones cambiarias interbancarias										
i. Al contado	262.2		268.8		618.7		467.0		532.0	
ii. A futuro	0.0		40.0		70.0		90.0		192.5	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-62.4		-68.4		-98.1		83.0		-143.5	
i. Compras	116.5		175.5		306.3		306.9		489.1	
ii. (-) Ventas	176.9		243.8		374.4		223.9		632.6	
f. Efecto de Opciones	2.8		0.5		0.0		0.0		0.0	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-0.5		164.9		52.4		-7.9		-0.9	
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera										
Tasa de interés										
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7561		3.7895		3.8020		3.7700		3.7459	

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera