BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	14 Mar 22	15 Mar 22	16 Mar 22	17 Mar 22	18 Mar 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**17 242,6**	**13 284,4**	**9 946,5**	**9 463,5**	**12 015,1**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. *Operaciones monetarias del BCR*					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	500.0	499.6		999.0	1000.0
Propuestas recibidas	1098.5	1120.2		539.4	1239.9
Plazo de vencimiento	28 d	34 d		32 d	33 d
Tasa de interés: Mínima	3.90	3.90		3.89	3.70
Máxima	3.97	3.97		3.98	3.96
Promedio	3.96	3.96		3.95	3.94
Saldo	6 516.4	7 380.2	7 380.2	7 380.2	7 488.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 21 de Marzo del 2022	2 251.8	2 251.8	2 251.8	2 251.8	1 632.7
Vencimiento de CD BCRP del 21 al 25 de Marzo de 2022	2 251.8	2 251.8	2 251.8	2 251.8	1 632.7
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 21 al 25 de Marzo 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 Repo de Cartera General		0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 21 al 25 de Marzo de 2022		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	6 425.3	6 425.3	6 425.3	6 425.3	6 425.3
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Junio del 2022	13.9	13.9	13.9	13.9	13.9
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 21 al 25 de Marzo de 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 21 al 25 de Marzo de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	300.0	200.0	200.0	199.8	1000.0
Propuestas recibidas	570.0	495.0	554.0	525.0	1416.4
Plazo de vencimiento	91 d	90 d	89 d	88 d	94 d
Máxim: Mínima	0.03	0.03	0.03	0.03	0.03
Máxima	0.04	0.03	0.03	0.03	0.03
Promedio	0.03	0.03	0.03	0.03	0.03
Saldo	21 517.5	21 717.5	21 717.5	21 917.5	20 917.4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 21 de Marzo del 2022	2 199.9	2 199.9	2 199.9	2199.9	85.0
Vencimiento de CDV BCRP del 21 al 25 de Marzo de 2022	2 199.9	2 199.9	2 199.9	2199.9	85.0
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 21 al 25 de Marzo de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	3 500.0 8 600.2	2 000.0 6 900.1	500.0 6 600.0	2 000.0 4 800.0	1 000.0 6 757.9
Propuestas recibidas	5 723.0 11 408.6	2 289.0 9 008.5	865.5 8 219.6	2 289.2 5 196.4	1 882.4 6 757.9
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	3.90 3.75	3.81 3.65	3.92 3.63	3.92 3.62	3.94 3.55
Máxima	4.00 3.82	4.00 3.79	4.00 3.75	4.00 3.70	3.98 3.94
Promedio	3.99 3.80	4.00 3.75	3.99 3.70	3.98 3.65	3.98 3.64
Saldo	14 600.1	14 900.0	14 900.0	15 099.9	15 757.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 21 de Marzo del 2022	8 600.2	6 900.1	6 900.1	6 600.0	10 257.9
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 21 al 25 de Marzo de 2022	11 100.1	9 400.0	16 000.0	13 899.9	12 757.9
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (CDLOCTP)					237.0
Propuestas recibidas					557.0
Plazo de vencimiento					182 d
Tasas de interés: Mínima					4.76
Máxima					5.47
Promedio					4.91
Saldo	4 693.4	4 693.4	4 693.4	4 693.4	4 693.4
Próximo vencimiento de ColocTP el 5 de Mayo del 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de ColocTP del 21 al 25 de Marzo de 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	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 21 al 25 de Marzo de 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 195.0	1 195.0	1 195.0	1 195.0	995.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 4 de Abril del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	400.0
Vencimiento de CDR BCRP del 21 al 25 de Marzo de 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	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 21 al 25 de Marzo de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1 822.0	1 822.0	1 822.0	1 822.0	1 822.0
Próximo vencimiento de Repo Regular el 21 de Marzo del 2022	400.0	400.0	400.0	400.0	400.0
Vencimiento de REPO del 21 al 25 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	600.0
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 21 al 25 de Marzo 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 Expansión					
Vencimiento de REPO Expansión del 21 al 25 de Marzo 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 Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 21 al 25 de Marzo de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	41 094.2	41 094.2	41 094.2	41 094.2	40 894.2
Próximo vencimiento de "S" Venta del 21 de Marzo del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	340.0
Vencimiento de "S" - Venta del 21 al 25 de Marzo de 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	1 210.0
xx. Subasta de Repo de Valores para mercado dólares (BRD)					
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 RED					
Vencimiento de RED del 21 al 25 de Marzo 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	150.0	150.0			150.0
Plazo de vencimiento	92 d	184 d			275 d
Tasas de interés: Mínima	4.59	4.80			5.18
Máxima	4.59	4.82			5.18
Promedio	4.59	4.81			5.18
Saldo	16 445.0	16 395.0	16 395.0	15 995.0	15 645.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 21 de Marzo del 2022	100.0	400.0	400.0	400.0	450.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 21 al 25 de Marzo de 2022	900.0	800.0	800.0	400.0	1 200.0
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	-355.4
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	0.0		0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
d. *Operaciones Forex de Mesa (millones de US$)*	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)	0.3	0.3	0.3	0.0	3.0
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 342,6**	**3 320,4**	**2 646,5**	**2 163,7**	**2 089,6**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0122%	0.0121%	0.0121%	0.0121%	0.0120%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 497.0	2 362.8	1 137.7	813.0	1 134.0
Tasa de interés	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**2 845,6**	**957,6**	**1 508,8**	**1 350,7**	**955,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 628.0	13 328.1	12 882.0	12 670.8	12 434.8
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7.1	7.0	6.7	6.6	6.5
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 393.0	6 093.3	5 654.3	5 442.9	5 206.8
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3.3	3.2	3.0	2.8	2.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. *Operaciones a la vista en moneda nacional*	500.0	568.6	931.0	907.1	988.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBOR	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 / 4.00	4.00 / 4.00 / 4.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	287.5	226.5	208.5	144.5	182.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	0.25 /0.25 / 0.25	0.25 /0.25 / 0.25	0.25 /0.25 / 0.25	0.50 / 0.50 / 0.50	0.50 / 0.50 / 0.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	3.0
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$)	**Mar.11, 2022**	**Mar.14, 2022**	**Mar.15, 2022**	**Mar.16, 2022**	**Mar.17, 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-93.3	19.5	65.3	21.4	63.0
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-118.4	87.6	255.8	-28.0	187.5
a. Mercado spot con el público	-127.1	90.1	236.5	-19.4	176.7
i. Compras	440.4	504.6	653.6	424.2	432.2
ii. (-) Ventas	567.5	414.4	417.1	443.6	255.5
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-3.6	-105.5	-180.1	143.0	-63.0
i. Pactadas	365.4	227.2	226.9	488.8	264.5
ii. (-) Vencidas	369.0	332.7	407.0	345.8	327.5
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-27.3	1.8	10.6	114.7	65.4
i. Pactadas	356.4	256.4	236.8	410.3	343.1
ii. (-) Vencidas	383.6	254.6	226.2	295.6	277.7
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	448.9	355.2	535.4	408.2	414.6
ii. A futuro	3.0	22.0	23.0	25.0	50.0
e. Operaciones swap asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	24.4	-82.9	-164.3	-49.7	-37.1
i. Compras	329.0	244.7	219.3	294.4	264.7
ii. (-) Ventas	304.6	327.6	383.6	344.1	301.8
f. Efecto de Opciones	1.4	0.2	0.3	21.1	3.9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-1.1	2.3	2.7	-9.1	-1.8
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.6908	3.7140	3.7356	3.7228	3.7350

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera