BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	28 Feb 22	01 Mar 22	02 Mar 22	03 Mar 22	04 Mar 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**13 590,9**	**11 837,6**	**12 493,3**	**13 332,2**	**15 159,6**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias en soles del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCR)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	6 123.4	6 123.4	6 123.4	6 003.4	6 003.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 7 de Marzo del 2022	120.0	120.0	120.0	1 495.0	1 495.0
Vencimiento de CD BCRP del 7 al 11 de Marzo de 2022	120.0	120.0	120.0	0.0	1 495.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					200.0
Propuestas recibidas					450.0
Plazo de vencimiento					3 d
Tasas de interés: Mínima					4.15
Máxima					4.15
Promedio					4.15
Saldo	5 362.4	5 762.4	5 362.4	5 362.4	5 562.4
Próximo vencimiento de Reco de Valores el 7 de Marzo del 2022	1 627.0	400.0	500.0	500.0	200.0
Vencimiento de Reco Valores del 7 al 11 de Marzo de 2022	1 627.0	400.0	0.0	0.0	200.0
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 7 al 11 de Marzo de 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	6 428.4	6 428.4	6 428.4	6 428.4	6 428.4
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Junio del 2022	14.5	14.5	14.5	14.5	14.5
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 7 al 11 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 Reco Especial - CDR del 7 al 11 de Marzo de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	700.0	300.0	200.0		300.0
Propuestas recibidas	850.0	400.0	200.0		500.0
Plazo de vencimiento	95 d	94 d	93 d		91 d
Mínimo: Mínima	0.04	0.04	0.04		0.04
Máxima	0.04	0.04	0.04		0.04
Promedio	0.04	0.04	0.04		0.04
Saldo	19 217.7	20 217.7	20 417.7	20 417.7	20 717.7
Vencimiento de CDV BCRP el 7 de Marzo del 2022	2 000.1	2 000.1	2 000.1	2 000.1	2 000.1
Vencimiento de CDV BCRP del 7 al 11 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	2 000.1
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 7 al 11 de Marzo de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 999.9 8 799.9	536.1 3 800.0	1 174.5 3 665.1	4 205.1	8 114.9
Propuestas recibidas	3 236.0 10 315.4	536.1 4 847.9	1 174.5 3 665.1	4 205.1	8 114.9
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	3.46 2.25	3.43 3.30	3.35 3.28	3.30	3.30
Máxima	3.50 3.35	3.50 3.35	3.50 3.48	3.50	3.50
Promedio	3.50 3.31	3.49 3.31	3.48 3.31	3.34	3.42
Saldo	18 700.2	11 136.0	11 575.6	6 710.5	12 825.4
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 7 de Marzo del 2022	12 700.1	4 400.0	4 865.1	2 000.0	11 114.8
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 7 al 11 de Marzo de 2022	27 500.1	7 600.0	6 865.1	2 000.0	12 825.4
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	500.1				
Propuestas recibidas	772.0				
Plazo de vencimiento	186 d				
Tasas de interés: Mínima	4.46				
Máxima	4.53				
Promedio	4.50				
Saldo	4 892.4	4 892.4	4 892.4	4 892.4	4 892.4
Próximo vencimiento de ColocTP el 18 de Marzo del 2022	500.1	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de ColocTP del 7 al 11 de Marzo de 2022	500.1	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 7 al 11 de Marzo de 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)	195.0				
Propuestas recibidas	195.0				
Plazo de vencimiento	88 d				
Tasas de interés: Mínima	0.24				
Máxima	0.60				
Promedio	0.49				
Saldo	1 400.0	1 195.0	1 195.0	1 195.0	1 195.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 18 de Marzo del 2022	400.0	200.0	200.0	200.0	200.0
Vencimiento de CDR BCRP del 7 al 11 de Marzo de 2022	400.0	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 7 al 11 de Marzo de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)		300.0			300.0
Propuestas recibidas		585.0			746.0
Plazo de vencimiento		7 d			7 d
Tasas de interés: Mínima		4.91			4.40
Máxima		4.91			4.99
Promedio		4.91			4.50
Saldo	2 452.0	2 752.0	2 752.0	2 752.0	2 822.0
Próximo vencimiento de Reco Regular el 8 de Marzo del 2022	230.0	230.0	230.0	230.0	300.0
Vencimiento de REPO del 7 al 11 de Marzo de 2022	230.0	230.0	230.0	230.0	1 000.0
xvi. Venta de Moneda Extranjera con compromiso de reventa					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo					
Próximo vencimiento de Reco					
Vencimiento de REPO del 7 al 11 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 Reco Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 7 al 11 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 Reco Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 7 al 11 de Marzo de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	300.0 300.0				
Propuestas recibidas	737.0 398.0				
Plazo de vencimiento	88 d 88 d				
Tasas de interés: Mínima	-0.10 -0.30				
Máxima	0.25 0.45				
Promedio	0.00 0.00				
Saldo	40 494.7	41 094.7	41 094.7	41 094.7	41 094.7
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 7 al 11 de Marzo de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
xx. Subasta de Repo de Valores para monedas distintas (BRTD)					
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 el 4 de Marzo del 2022					
Vencimiento de RED del 7 al 11 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	89 d	184 d			275 d
Tasas de interés: Mínima	4.10	4.35			4.45
Máxima	4.12	4.35			4.45
Promedio	4.11	4.35			4.45
Saldo	19 545.0	18 395.0	18 095.0	17 795.0	17 845.0
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 6 de Marzo del 2022	400.0	300.0	300.0	350.0	350.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 7 al 11 de Marzo de 2022	1 450.0	600.0	300.0	0.0	700.0
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	-264.7	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	70.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	3.7864	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	0.5	0.5	0.2	0.0	3.8
i. Compras (millones de US$)	0.5	0.5	0.2	0.0	3.8
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**3 287,9**	**7 901,5**	**7 533,7**	**8 897,1**	**7 113,7**
4. Operaciones monetarias del BCR sana el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0120%	0.0119%	0.0120%	0.0121%	0.0112%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%	4.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 735.6	95.2	229.0	505.4	23.2
Tasa de interés	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%	2.25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**1 552,3**	**7 806,3**	**7 304,7**	**8 391,7**	**7 090,5**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	10 529.7	10 478.4	15 027.2	14 689.4	15 191.9
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5.5	5.4	7.9	7.7	8.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 683.1	3 630.9	7 806.3	7 471.9	7 973.6
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1.9	1.9	4.1	3.9	4.2
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	499.0	819.0	537.0	436.0	841.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIPM	3.50 / 3.60 / 3.52	3.50 / 3.60 / 3.58	3.50 / 3.60 / 3.56	3.50 / 3.60 / 3.58	3.70 / 3.80 / 3.73
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	145.0	213.0	285.5	222.5
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio		0.25 /0.25 / 0.25	0.25 /0.25 / 0.25	0.25 /0.25 / 0.25	0.25 /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.25, 2022**	**Feb.28, 2022**	**Mar.01, 2022**	**Mar.02, 2022**	**Mar.03, 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	50.0	88.2	48.0	10.8	-32.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-102.2	-172.1	11.4	-193.1	-69.0
a. Mercado spot con el público	-77.4	-183.9	24.8	-182.3	-53.5
i. Compras	566.2	469.6	335.1	228.2	371.5
ii. (-) Ventas	643.6	653.5	310.5	410.5	424.9
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	355.9	297.9	156.4	201.7	-16.2
i. Pactadas	652.8	454.3	376.0	393.9	322.5
ii. (-) Vencidas	296.9	156.4	219.6	192.1	338.8
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	192.9	198.7	111.7	16.2	-52.7
i. Pactadas	443.9	375.2	336.9	414.8	174.4
ii. (-) Vencidas	250.9	176.5	225.2	398.4	227.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	516.5	420.2	587.5	157.2	321.2
ii. A futuro	26.0	30.0	130.5	32.0	126.0
e. Operaciones asoc asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-57.3	8.4	-2.1	205.6	-116.2
i. Compras	229.9	155.6	211.1	396.2	220.6
ii. (-) Ventas	287.2	147.2	213.2	190.7	336.8
f. Efecto de Opciones	-9.9	1.5	-8.2	16.4	-0.1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-13.5	183.1	-5.5	-10.1	-11.0
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7563	3.7573	3.7934	3.7628	3.7250

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera