BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	11 Abr 22		12 Abr 22		13 Abr 22	
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10 355,6**		**7 882,2**		**5 051,0**	
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)	1000,0		1000,0		500,0	
Propuestas recibidas	2092,5		1474,8		887,8	
Plazo de vencimiento	35 d		35 d		34 d	
Tasas de interés: Mínima	4,30		3,83		4,33	
Máxima	4,47		4,44		4,42	
Promedio	4,43		4,42		4,41	
Saldo	7 044,8		8 162,8		9 162,8	
Próximo vencimiento de CD BCRP el 20 de Abril del 2022	2 008,0		1 463,8		1 463,8	
Vencimiento de CD BCRP del 18 al 22 de Abril de 2022	2 008,0		0,0		0,0	
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	500,0		300,0		300,0	
Propuestas recibidas	1200,0		300,0		700,0	
Plazo de vencimiento	1 d		1 d		5 d	
Tasas de interés: Mínima	4,50		4,52		4,50	
Máxima	4,68		4,52		4,55	
Promedio	4,57		4,52		4,53	
Saldo	6 162,4		5 662,4		5 662,4	
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 28 de Abril del 2022	800,0		300,0		800,0	
Vencimiento de Repo Valores del 18 al 22 de Abril de 2022	1 300,0		300,0		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	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera General	0,0		0,0		0,0	
Vencimiento de Repo de Cartera General del 18 al 22 de Abril de 2022	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	
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 6 de Junio del 2022	13,9		13,9		13,9	
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 18 al 22 de Abril de 2022	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	
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	
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 18 al 22 de Abril de 2022						
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	300,0				200,0	
Propuestas recibidas	300,0				460,0	
Plazo de vencimiento	91 d				89 d	
Márgen: Mínima	0,04				0,03	
Máxima	0,04				0,04	
Promedio	0,04				0,04	
Saldo	19 817,7		20 117,7		20 317,7	
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 25 de Abril del 2022	2 000,0		2 000,0		2 000,0	
Vencimientos de CDV BCRP del 18 al 22 de Abril de 2022	0,0		0,0		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 18 al 22 de Abril de 2022						
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	1 499,9	1 800,0	1 465,5	800,0	500,0	600,0
Propuestas recibidas	2 553,0	4 046,8	1 465,5	1 909,8	798,0	1 963,2
Plazo de vencimiento	7 d	1 d	7 d	1 d	7 d	5 d
Tasas de interés: Mínima	4,10	4,00	4,40	3,80	4,27	3,25
Máxima	4,50	4,03	4,50	3,98	4,42	3,50
Promedio	4,44	4,02	4,47	3,91	4,39	3,50
Saldo	3 500,0		3 765,4		4 065,4	
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 19 de Abril del 2022	3 500,0		800,0		2 099,9	
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 18 al 22 de Abril de 2022	5 300,0		800,0		0,0	
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de interés: Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	4 569,4		4 569,4		4 569,4	
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 9 de Mayo del 2022	500,0		500,0		500,0	
Vencimiento de Coloc-TP del 18 al 22 de Abril de 2022	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 18 al 22 de Abril 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	595,0		595,0		395,0	
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 27 de Mayo del 2022	200,0		200,0		200,0	
Vencimiento de CDR BCRP del 18 al 22 de Abril de 2022	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 18 al 22 de Abril de 2022						
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	300,0		300,0		200,0	
Propuestas recibidas	552,0		602,5		400,0	
Plazo de vencimiento	7 d		7 d		7 d	
Tasas de interés: Mínima	5,05		5,15		4,95	
Máxima	5,30		5,15		5,30	
Promedio	5,12		5,15		5,11	
Saldo	3 222,0		2 922,0		2 422,0	
Próximo vencimiento de Repo Regular el 19 de Abril del 2022	900,0		700,0		700,0	
Vencimiento de REPO del 18 al 22 de Abril de 2022	1 600,0		700,0		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 Repo						
Vencimiento de REPO del 18 al 22 de Abril 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 del 18 al 22 de Abril 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 del 18 al 22 de Abril de 2022						
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					200,0 150,0	200,0
Propuestas recibidas					400,0 350,0	320,0
Plazo de vencimiento					275 d 183 d	365 d
Tasas de interés: Mínima					1,45 1,20	1,70
Máxima					1,60 1,28	1,75
Promedio					1,55 1,24	1,73
Saldo	35 072,9		34 832,9		34 955,9	
Próximo vencimiento de SC-Venta el 19 de Abril del 2022	240,0		427,0		130,0	
Vencimiento de SC - Venta del 18 al 22 de Abril de 2022	667,0		427,0		0,0	
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)						
Propuestas recibidas						
Plazo de vencimiento						
Tasas de interés: Mínima						
Máxima						
Promedio						
Saldo	0,0		0,0		0,0	
Próximo vencimiento de RED						
Vencimiento de RED del 18 al 22 de Abril de 2022	0,0		0,0		0,0	
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	100,0		100,0			
Propuestas recibidas	200,0		300,0			
Plazo de vencimiento	91 d		183 d			
Tasas de interés: Mínima	5,00		5,34			
Máxima	5,00		5,40			
Promedio	5,00		5,37			
Saldo	11 595,1		11 745,1		11 745,1	
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 19 de Abril del 2022	50,0		100,0		100,0	
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 18 al 22 de Abril de 2022	100,0		100,0		100,0	
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	
i. Compras (millones de US$)	0,0		0,0		0,0	
Tipo de cambio promedio	0,0000		0,0000		0,0000	
ii. Ventas (millones de US$)	0,0		0,0		0,0	
Tipo de cambio promedio	0,0000		0,0000		0,0000	
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	4,5		-1,5		1,5	
i. Compras (millones de US$)	4,5		0,0		1,5	
ii. Ventas (millones de US$)	0,0		1,5		0,0	
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP						
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR						
ii. Compras de BTP (Valorizado)						
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**6 349,7**		**4 850,7**		**3 251,0**	
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones						
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).						
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0149%		0,0149%		0,0137%	
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)						
Tasa de interés	5,00%		5,00%		5,00%	
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional						
Tasa de interés						
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	642,0		848,3		930,0	
Tasa de interés	3,00%		3,00%		3,00%	
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**5 707,7**		**4 002,4**		**2 321,0**	
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	14 310,3		14 175,9		13 842,0	
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	7,6		7,5		7,3	
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	6 651,1		6 519,8		6 195,0	
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	3,5		3,4		3,3	
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP						
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 083,7		893,2		1 175,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	4,50 / 4,50 / 4,50		4,50 / 4,50 / 4,50		4,50 / 4,50 / 4,50	
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0,0		0,0		0,0	
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio						
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	28,8		33,3		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$)	**Abri.08, 2022**		**Abri.11, 2022**		**Abri.12, 2022**	
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	115,3		-68,3		-72,0	
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	91,4		25,1		-49,6	
a. Mercado spot con el público	98,2		63,2		-48,2	
i. Compras	474,4		464,3		511,8	
ii. (-) Ventas	376,2		401,2		560,0	
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	-92,4		219,1		-196,9	
i. Pactadas	95,2		292,8		352,3	
ii. (-) Vencidas	187,6		73,7		549,2	
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	-182,1		312,5		-260,5	
i. Pactadas	177,2		474,5		536,9	
ii. (-) Vencidas	359,3		162,0		797,4	
d. Operaciones cambiarias interbancarias						
i. Al contado	378,7		283,4		267,7	
ii. A futuro	90,0		50,0		50,0	
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	165,1		51,7		244,2	
i. Compras	342,8		122,1		779,7	
ii. (-) Ventas	177,7		70,4		535,6	
f. Efecto de Opciones	-1,6		0,0		-20,0	
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-64,5		-1,5		-63,4	
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera						
Tasa de interés						
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7121		3,7131		3,7004	
(*) Datos preliminares						

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera