BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	6 Jun 22	7 Jun 22	8 Jun 22	9 Jun 22	10 Jun 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**10,452.5**	**10,580.9**	**9,073.0**	**9,925.7**	**10,001.0**
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)					
Propuestas recibidas					500.0
Plazo de vencimiento					1070.0
Tasas de interés: Mínima					35 d
Máxima					4.80
Promedio					5.40
Saldo	6,639.8	6,639.8	6,639.8	6,639.8	5.32
Próximo vencimiento de CD BCRP el 15 de Junio del 2022	2,010.0	2,010.0	2,010.0	2,010.0	7,609.8
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de Junio de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	2,010.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	200.0	200.0	500.0		
Propuestas recibidas	386 d	509 d	33 d		
Plazo de vencimiento	28.0	27.0	28.0		
Tasas de interés: Mínima	5.67	5.66	5.69		
Máxima	5.68	5.71	5.71		
Promedio	5.68	5.69	5.70		
Saldo	10,562.4	8,962.4	9,462.4	9,462.4	9,462.4
Próximo vencimiento de Reso de Valores el 20 de Junio del 2022	1,800.0	1,100.0	1,100.0	1,100.0	1,100.0
Vencimiento de Reso Valores del 13 al 17 de Junio de 2022	1,800.0	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 Reso de Cartera General del 13 al 17 de Junio de 2022	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	6,389.0	6,389.0	6,389.0	6,389.0	6,389.0
Próximo vencimiento de Reso de Cartera Alternativa el 1 de Agosto del 2022	1.2	1.2	1.2	1.2	1.2
Vencimiento de Reso de Cartera Alternativa del 13 al 17 de Junio 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 13 al 17 de Junio de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)				500.0	1200.0
Propuestas recibidas				1770.0	3150.0
Plazo de vencimiento				95 d	94 d
Mínimo: Mínima				0.02	0.02
Máxima				0.03	0.02
Promedio				0.03	0.02
Saldo	17,134.7	17,134.7	17,134.7	17,634.7	15,435.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 13 de Junio del 2022	1,999.9	1,999.9	1,999.9	1,999.9	1,815.0
Vencimientos de CDV BCRP del 13 al 17 de Junio de 2022	1,999.9	1,999.9	1,999.9	1,999.9	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 13 al 17 de Junio de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (TIC BCRP)	500.0	500.0	1,300.0	500.0	500.0 / 3,500.0
Propuestas recibidas	1,885.0	2,277.9	2,151.9	2,274.4	1,954.0 / 6,179.5
Plazo de vencimiento	1 d	1 d	1 d	1 d	7 d / 3 d
Tasas de interés: Mínima	3.55	3.80	3.79	3.44	4.50 / 3.50
Máxima	4.50	4.19	4.00	3.55	5.29 / 4.00
Promedio	4.24	3.98	3.88	3.53	5.07 / 3.97
Saldo	0.0	0.0	0.0	500.0	500.0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de Junio del 2022	0.0	0.0		500.0	500.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de Junio de 2022	0.0	0.0		500.0	500.0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)	300.0	300.0	300.0		
Propuestas recibidas	736 d	555 n	555 n		
Plazo de vencimiento	179 d	728 d	385.1		
Tasas de interés: Mínima	6.57	179 d	180 d		
Máxima	6.75	6.75	6.75		
Promedio	6.70	6.70	6.75		
Saldo	6,174.0	6,174.0	6,474.0	6,474.0	6,341.9
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 13 de Junio del 2022	132.1	132.1	132.1	132.1	200.0
Vencimiento de Coloc-TP del 13 al 17 de Junio de 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	200.0
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 13 al 17 de Junio 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0.0	0.0		0.0	0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de Junio de 2022	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 13 al 17 de Junio de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Swap)			500.0		
Propuestas recibidas			487.0		
Plazo de vencimiento			33 d		
Tasas de interés: Mínima			7.00		
Máxima			7.10		
Promedio			6.16		
Saldo	2,377.0	2,377.0	2,077.0	2,077.0	2,077.0
Próximo vencimiento de Swap Cambiario el 1 de Julio del 2022	500.0	500.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de Junio de 2022	500.0	500.0	0.0	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 del 13 al 17 de Junio 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 13 al 17 de Junio 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 Reso Sustitución					
Vencimiento de REPO Sustitución del 13 al 17 de Junio de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	200.0 / 160.0	Desierta / 200.0	200.0 / 200.0		
Propuestas recibidas	365 n / 364 n	365 n / 365 n	366 n / 366 n		
Plazo de vencimiento	365 d / 365 d	365 d / 365 d	365 d / 365 d		
Tasas de interés: Mínima	2.35 / 2.35	0.00 / 2.37	2.33 / 1.25		
Máxima	2.38 / 2.45	0.00 / 2.40	2.39 / 1.55		
Promedio	2.36 / 2.40	0.00 / 2.38	2.36 / 1.40		
Saldo	26,118.9	26,318.9	26,518.9	26,518.9	26,518.9
Próximo vencimiento de SC-Venta el 16 de Junio del 2022	100.0	100.0	200.0	205.0	205.0
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de Junio de 2022	100.0	100.0	0.0	0.0	705.1
xx. Subasta de Reso de Valores para proveer dólares (RED)					
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 13 al 17 de Junio de 2022	0.0	0.0		0.0	0.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	200.0	50.0			50.0
Propuestas recibidas	600.0	150.0			100.0
Plazo de vencimiento	273 d	183 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	1.15	5.94			6.54
Máxima	1.22	5.95			6.14
Promedio	1.18	5.95			6.08
Saldo	8,695.1	8,945.1	8,945.1	8,945.1	8,595.1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 13 de Junio del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	300.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 13 al 17 de Junio de 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	300.0
b. Listal, Repo 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$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Tipo de cambio promedio	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
ii. Ventas (millones de US$)	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 Fuera de Mesa (millones de US$)	0.0	0.0	2.4	3.8	2.3
i. Compras (millones de US$)	0.0	0.0	2.4	3.8	2.3
ii. Ventas (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP, CDBCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**10,980.6**	**10,240.9**	**9,482.0**	**8,935.7**	**6,991.9**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.1480%	0.1470%	0.1470%	0.1470%	0.0164%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta).					
Tasa de interés	5.50%	5.50%	5.50%	5.50%	6.00%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	161.8	161.8	147.7	438.8	2,028.9
Tasa de interés	5.50%	5.50%	5.50%	5.50%	5.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**10,718.8**	**10,079.1**	**9,334.3**	**8,496.9**	**4,963.0**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	18,356.6	18,356.6	18,356.3	17,814.9	17,827.3
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TCSD) (*)	9.5	9.5	9.4	9.3	9.1
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	11,018.9	10,971.3	10,778.6	10,538.3	10,248.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCSD) (*)	5.7	5.7	5.5	5.5	5.3
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,201.5	1,139.0	1,424.8	1,416.0	212.6
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	4.75 / 5.00/ 5.00	5.00 / 5.00/ 5.00	4.75 / 5.00/ 5.00	4.50 / 5.00/ 4.99	4.00 / 5.5/ 4.59
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	66.0	47.0	63.0	54.0	63.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00	1.00 / 1.00 / 1.00
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$)	**Jun.03, 2022**	**Jun.06, 2022**	**Jun.07, 2022**	**Jun.08, 2022**	**Jun.09, 2022**
Flujo de la posición global = a + b1 - c.i + e + f + g	-2.9	-41.0	125.1	-23.3	-163.6
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-102.7	-24.9	64.0	-292.8	-181.8
a. Mercado spot con el público	-84.4	-5.9	81.1	-290.2	-163.6
i. Compras	374.4	336.7	427.7	397.4	471.7
ii. (-) Ventas	458.8	342.6	346.6	687.6	635.3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	93.6	117.2	91.2	-70.1	-139.6
i. Pactadas	234.3	281.9	286.2	133.4	214.1
ii. (-) Vencidas	143.7	164.7	195.0	203.5	353.7
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	43.5	53.1	23.2	-223.2	-182.2
i. Pactadas	220.1	228.2	330.7	330.4	165.6
ii. (-) Vencidas	176.6	175.2	307.4	553.6	347.9
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	205.1	386.3	300.9	243.3	274.5
ii. A futuro	0.0	64.0	63.0	10.0	0.0
e. Operaciones sand asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	21.0	0.4	102.1	255.0	-21.6
i. Compras	158.3	162.0	295.5	552.2	328.8
ii. (-) Ventas	137.3	161.7	193.3	197.2	350.5
f. Efecto de Opciones	0.1	-0.4	-1.4	-0.1	0.0
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	46.2	-88.7	-12.4	109.0	-26.9
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.7082	3.7320	3.7537	3.7569	3.7538

(*) Datos preliminares