BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	23 May 22	24 May 22	25 May 22	26 May 22	27 May 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**5 631,6**	**5 066,6**	**3 997,2**	**4 871,0**	**3 907,2**
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)		200,0			
Propuestas recibidas		551,0			
Plazo de vencimiento		31 d			
Tasas de interés: Mínima		4,63			
Máxima		4,70			
Promedio		4,67			
Saldo	6 339,8	6 639,8	6 639,8	6 639,8	6 639,8
Próximo vencimiento de CD BCRP ESPAÑOL	2 010,0	2 010,0	2 010,0	2 010,0	2 010,0
Vencimiento de CD BCRP del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	300,0		400,0	300,0	300,0 500,0
Propuestas recibidas	850,0		850,0	1000,0	1020,0 1100,0
Plazo de vencimiento	28 d		7 d	25 d	35 d 7 d
Tasas de interés: Mínima	5,50		5,20	5,61	5,75 5,25
Máxima	5,66		5,40	5,73	5,77 5,50
Promedio	5,60		5,30	5,66	5,76 5,39
Saldo	5 962,4	5 962,4	6 362,4	6 662,4	6 762,4
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 15 de Junio del 2022	700,0	700,0	700,0	700,0	400,0
Vencimiento de Repo Valores del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	700,0	700,0	700,0	700,0	900,0
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 30 de Mayo al 3 de Junio 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	6 401,7	6 401,7	6 401,7	6 401,7	6 401,7
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativo el 27 de Mayo del 2022	12,6	12,6	12,6	12,6	12,6
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativo del 30 de Mayo al 3 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 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)	1000,0	700,0			800,0
Propuestas recibidas	1800,0	1010,0			1025,0
Plazo de vencimiento	91 d	94 d			91 d
Márgen: Mínima	0,03	0,03			0,03
Máxima	0,04	0,04			0,03
Promedio	0,03	0,03			0,03
Saldo	18 189,6	18 889,6	18 889,6	18 889,6	18 134,7
Próximo vencimiento de CDV BCRP	1 554,9	1 554,9	1 554,9	1 554,9	1 500,0
Vencimientos de CDV BCRP del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	1 554,9	1 554,9	1 554,9	1 554,9	1 500,0
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 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (DP BCRP)	2 200,0	1000,0 1400,0	1000,0 1643,1	500,0 1868,1	3008,0
Propuestas recibidas	3 119,6	1220,0 2439,5	1488,0 1643,1	729,0 1868,1	3008,0
Plazo de vencimiento	1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	7 d 1 d	3 d
Tasas de interés: Mínima	3,50	4,50 3,50	4,65 3,35	4,50 3,35	3,75
Máxima	3,80	4,95 3,65	4,90 5,00	4,87 5,00	5,00
Promedio	3,70	4,84 3,59	4,83 3,57	4,83 4,08	4,56
Saldo	4 352,7	3 552,7	4 033,5	4 368,1	5 508,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	3 200,0	2 162,3	2 033,5	1 868,1	3 008,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	4 352,7	2 552,7	2 033,5	1 868,1	5 508,0
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)			300,0		300,0
Propuestas recibidas			659,2		605,7
Plazo de vencimiento			180 d		185 d
Tasas de interés: Mínima			6,41		6,45
Máxima			6,68		6,70
Promedio			6,43		6,47
Saldo	5 774,0	5 774,0	6 074,0	6 074,0	6 374,0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 31 de Mayo del 2022	500,0	500,0	500,0	500,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	0,0	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 30 de Mayo al 3 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	195,0	195,0	195,0	195,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	195,0	195,0	195,0	195,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	195,0	195,0	195,0	195,0	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 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022					
xv. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	2 377,0	2 377,0	2 377,0	2 377,0	1 677,0
Próximo vencimiento de Repo Regular	700,0	700,0	700,0	700,0	300,0
Vencimiento de REPO del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	700,0	700,0	700,0	700,0	300,0
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 30 de Mayo al 3 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 Expansion					
Vencimiento de REPO Expansión del 30 de Mayo al 3 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 Repo Sustitucion					
Vencimiento de REPO Sustitución del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					100,0
Propuestas recibidas					148,0
Plazo de vencimiento					364 d
Tasas de interés: Mínima					2,40
Máxima					2,40
Promedio					2,40
Saldo	35 833,9	35 823,9	35 823,9	35 823,9	35 323,9
Próximo vencimiento de SC-Venta	10,0	600,0	600,0	600,0	400,0
Vencimiento de SC - Venta del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	610,0	600,0	600,0	600,0	400,0
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	0,0	0,0
Próximo vencimiento de RED el 31 de Mayo del 2022					
Vencimiento de RED del 30 de Mayo al 3 de Junio 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	100,0			150,0
Plazo de vencimiento	92 d	184 d			276 d
Tasas de interés: Mínima	5,65	5,81			5,91
Máxima	5,65	5,81			5,93
Promedio	5,65	5,81			5,92
Saldo	10 145,1	10 195,1	10 195,1	10 195,1	10 095,1
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés	150,0	150,0	150,0	150,0	50,0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 30 de Mayo al 3 de Junio de 2022	150,0	150,0	150,0	150,0	850,0
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	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$)	-0,1	3,4	2,1	0,0	2,4
i. Compras (millones de US$)	0,1	3,4	2,1	0,0	2,4
ii. Ventas (millones de US$)	0,3	0,0	0,0	0,0	0,0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**2 731,6**	**1 666,6**	**1 997,2**	**2 371,0**	**1 199,2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0149%	0,0148%	0,0150%	0,0151%	0,0150%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%	5,50%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 755,5	959,3	1 048,3	1 367,3	419,4
Tasa de interés	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%	3,25%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**976,1**	**707,3**	**948,9**	**1 003,7**	**779,8**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	13 024,9	12 812,6	12 615,4	12 462,2	12 313,6
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,7	6,6	6,5	6,5	6,4
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	5 565,8	5 363,4	5 166,3	5 013,4	4 866,9
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,9	2,8	2,7	2,6	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	988,8	1 401,6	1 235,7	1 039,2	642,4
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBO	4,50 / 5,00 / 5,00	4,75 / 5,00 / 5,00	4,50 / 5,00 / 5,00	4,50 / 5,10 / 5,00	4,25 / 5,10 / 4,95
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	199,5	92,0	95,0	0,0	20,0
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
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$)	**May.20, 2022**	**May.23, 2022**	**May.24, 2022**	**May.25, 2022**	**May.26, 2022**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	77,7	-22,4	71,2	-54,8	-24,3
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	29,6	-138,6	103,1	-18,3	-234,2
a. Mercado spot con el público	50,0	-121,0	100,2	-15,2	-193,6
i. Compras	357,5	345,4	658,8	691,6	665,7
ii. (-) Ventas	307,5	466,5	558,6	706,8	859,3
b. Compras forward y swap al público (con y sin entrega)	109,8	32,3	38,0	156,3	-25,1
i. Pactadas	135,1	283,3	90,1	251,8	402,8
ii. (-) Vencidas	25,3	251,0	52,1	95,6	427,9
c. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	52,9	-108,9	69,6	198,8	-233,7
i. Pactadas	225,5	194,6	521,2	568,2	351,5
ii. (-) Vencidas	172,6	303,4	451,6	369,3	585,2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	283,4	205,4	444,4	355,4	446,1
ii. A futuro	60,0	0,0	60,0	10,0	100,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	135,0	39,8	403,5	273,2	120,3
i. Compras	153,6	275,9	450,2	362,0	547,4
ii. (-) Ventas	18,5	236,1	46,6	88,8	427,1
f. Efecto de Opciones	-8,9	-0,1	2,4	6,0	1,4
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-8,1	-29,8	-3,8	-2,6	-3,6
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,7285	3,7130	3,7175	3,6861	3,6519
(*) Datos preliminares					

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera