BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	3 Ene 22	4 Ene 22	5 Ene 22	6 Ene 22	7 Ene 22
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**14,634.3**	**17,213.0**	**19,113.8**	**20,413.5**	**20,060.2**
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)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	14,346.9	12,161.9	12,161.9	12,161.9	12,082.4
Próximo vencimiento de CD BCRP el 14 de Enero del 2022	2,185.0	79.5	79.5	79.5	1,765.5
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de Enero 2022	2,264.5	79.5	79.5	79.5	1,765.5
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	5,763.3	5,763.3	5,763.3	5,563.3	5,363.3
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 27 de Enero del 2022	200.0	200.0	200.0	200.0	0.0
Vencimiento de Repo Valores del 10 al 14 de Enero 2022	400.0	400.0	400.0	200.0	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	0.0
Vencimiento de Repo de Cartera General del 10 al 14 de Enero 2022	0.0	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	6,442.0	6,440.7	6,440.7	6,440.7	6,440.7
Próximo vencimiento de Repo de Cartera Alternativa el 13 de Enero del 2022	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Vencimiento de Repo de Cartera Alternativa del 10 al 14 de Enero 2022	0.0	0.0	0.0	0.0	1.6
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 10 al 14 de Enero 2022					
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	12,664.4	12,664.4	12,664.4	12,664.4	12,664.4
Próximo vencimiento de CDV BCRP el 17 de Enero del 2022	750.0	750.0	750.0	750.0	750.0
Vencimiento de CDV BCRP del 10 al 14 de Enero 2022	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
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 10 al 14 de Enero 2022					
x. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional (TID BCRP)	357.4 5,434.3	6,490.6	8,519.5	11,201.9	3,327.5 13,415.8
Propuestas recibidas	357.4 5,434.3	6,490.6	8,519.5	11,201.9	3,327.5 13,415.8
Plazo de vencimiento	7 d 1 d	1 d	1 d	1 d	7 d 3 d
Tasas de interés: Mínima	2.48 2.47	2.47	2.47	2.47	2.90 2.80
Máxima	2.50 2.50	2.50	2.50	2.50	3.00 3.00
Promedio	2.49 2.49	2.49	2.49	2.49	2.95 2.98
Saldo	9,351.3	9,357.6	10,186.4	11,598.3	13,557.4
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 10 de Enero del 2022	6,434.3	7,690.7	9,829.0	11,201.9	12,057.4
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 10 al 14 de Enero 2022	8,943.9	9,000.2	9,829.0	11,201.9	13,557.4
xi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público (COLOCTP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,637.5	4,637.5	4,637.5	4,637.5	4,637.5
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 21 de Febrero del 2022	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0	1,000.0
Vencimiento de Coloc-TP del 10 al 14 de Enero 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 10 al 14 de Enero 2022					
xiii. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés: Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,150.0	1,150.0	1,150.0	1,150.0	1,150.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 14 de Enero del 2022	350.0	350.0	350.0	350.0	350.0
Vencimiento de CDR BCRP del 10 al 14 de Enero 2022	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	350.0
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					
Vencimiento de CD BCRP del 10 al 14 de Enero 2022					
xv. Contrato con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)	100.0				
Propuestas recibidas	262.0				
Plazo de vencimiento	31 d				
Tasas de interés: Mínima	2.80				
Máxima	3.01				
Promedio	2.88				
Saldo	3,342.1	3,342.1	3,342.1	3,242.0	2,142.0
Próximo vencimiento de Repo Dólar el 13 de Enero del 2022	100.1	100.1	100.1	100.0	200.0
Vencimiento de REPO del 10 al 14 de Enero 2022	200.1	200.1	200.1	100.0	800.0
xvi. Subasta 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 10 al 14 de Enero 2022					
xvii. Contrato 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 10 al 14 de Enero 2022					
xviii. Contrato 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 10 al 14 de Enero 2022					
xix. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP	80.0		200.0 300.0 200.0	200.0 200.0	
Propuestas recibidas	80.0		350.0 560.0 500.0	270.0 212.0	
Plazo de vencimiento	273 d		90 d 365 d 365 d	90 d 273 d	
Tasas de interés: Mínima	0.55		0.54 0.50 0.49	0.51 0.49	
Máxima	0.60		0.57 0.50 0.51	0.55 0.60	
Promedio	0.58		0.55 0.50 0.49	0.53 0.55	
Saldo	37,669.2	37,489.2	37,989.2	38,389.2	38,389.2
Próximo vencimiento de SC-Venta el 14 de Enero del 2022	200.0	200.0	500.0	500.0	500.0
Vencimiento de "S" - Venta del 10 al 14 de Enero 2022	400.0	200.0	0.0	0.0	500.0
xx. Subasta de Repo de Valores para proveer dólares (RED)		80.0			
Propuestas recibidas		80.0			
Plazo de vencimiento		14 d			
Tasas de interés: Mínima		0.30			
Máxima		0.30			
Promedio		0.30			
Saldo	150.0	130.0	130.0	130.0	130.0
Próximo vencimiento de RED el 13 de Enero del 2022	100.0	50.0	50.0	50.0	50.0
Vencimiento de RED del 10 al 14 de Enero 2022	100.0	0.0	0.0	0.0	50.0
xxi. Subasta de Swap de Tasas de Interés	150.0	50.0			70.0
Propuestas recibidas	150.0	150.0			273.0
Plazo de vencimiento	90 d	181 d			273 d
Tasas de interés: Mínima	2.96	3.22			3.90
Máxima	2.96	3.22			3.95
Promedio	2.96	3.22			3.93
Saldo	19,994.9	19,844.9	19,844.9	19,844.9	19,894.9
Próximo vencimiento de Swap Tasas de Interés el 18 de Enero del 2022	100.0	100.0	100.0	100.0	100.0
Vencimiento de Swap de Tasas de Interés del 10 al 14 de Enero 2022	200.0	100.0	0.0	0.0	0.0
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	639.5	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)	160.0				
Tipo de cambio promedio	3.9970				
d. Operaciones Fuera de Mesa (millones de US$)	-45.0	-29.7	-70.0	-22.0	18.3
i. Compras (millones de US$)	0.0	3.3	0.0	0.0	18.3
ii. Ventas (millones de US$)	45.0	33.0	70.0	22.0	0.0
e. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTD	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP (Valorizado)					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**8,393.1**	**10,722.4**	**10,594.3**	**9,211.6**	**6,860.2**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swap)					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0089%	0.0089%	0.0089%	0.0089%	0.0098%
b. Compra temporal de valores (Repo de subasta)					
Tasa de interés	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.50%
c. Crédito por resolución monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1,020.0	1,039.0	1,276.9	1,171.0	1,528.0
Tasa de interés	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%	1.85%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**7,293.1**	**9,683.4**	**9,317.4**	**8,040.6**	**5,332.2**
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9,827.8	11,501.9	11,925.9	13,477.3	13,479.5
b. Exceso de encaje en moneda nacional promedio acumulado (%) del TRCE (*)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,290.4	4,883.3	6,323.3	6,781.3	8,761.7
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TCEO) (*)	1.7	2.5	3.3	3.5	3.5
6. Operaciones cambiarias interbancarias y mercado de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	85.0	0.0	0.0	85.0	500.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / TIBN	3.40 / 3.40 / 3.40	3.40 / 3.40 / 3.40	3.40 / 3.40 / 3.40	3.40 / 3.40 / 3.40	3.00 / 3.00 / 3.00
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	65.0	89.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio				0.25 / 0.25 / 0.25	0.25 / 0.25 / 0.25
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	2.5	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$)	**Dic. 31, 2021**	**Ene.03, 2022**	**Ene.04, 2022**	**Ene.05, 2022**	**Ene.06, 2022**
Efecto de la posición global = a + b + c - d + e + f + g + h	57.5	147.5	-164.6	-49.1	77.6
Flujo de la posición contable = a + b + c - d + e + g	0.5	112.4	-204.2	-75.2	-66.4
a. Mercado spot con el público	-2.9	13.7	-184.2	-75.3	-54.1
i. Compras	181.5	158.7	151.5	258.0	246.4
ii. (-) Ventas	184.4	145.1	335.7	333.2	300.6
b. Compras forward o swap al público (con y sin entrega)	48.2	108.7	66.5	29.4	-94.3
i. Pactadas	290.0	206.1	360.9	184.6	290.0
ii. (-) Vencidas	241.8	97.4	292.4	155.2	384.3
c. Ventas forward o swap al público (con y sin entrega)	11.4	57.8	-21.9	142.4	-138.5
i. Pactadas	82.5	234.4	215.5	237.4	258.5
ii. (-) Vencidas	71.1	176.6	237.4	95.0	397.1
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	36.5	163.6	522.6	527.8	397.1
ii. A futuro	0.0	0.0	37.0	0.0	14.0
e. Operaciones asociadas a swaps o vencimientos de forwards sin entrega	-171.3	69.5	-74.0	-59.2	0.4
i. Compras	69.1	163.3	213.5	93.8	380.4
ii. (-) Ventas	240.4	93.9	287.6	153.0	380.0
f. Efecto de Opciones	0.0	0.0	-2.4	0.5	-0.9
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	4.0	87.7	-49.4	127.7	100.8
h. Crédito por resolución monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3.9734	3.9955	3.9642	3.9562	3.9715

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera